

Halvårsredogörelse 2023

# Fondrapporter från Handelsbanken Fonder

Del 2/2

- Passivt förvaltade fonder

# Halvåret 2023 - Våra passivt förvaltade fonder

## Aktiefonder

Handelsbanken Emerging Markets Index .....	3
Handelsbanken Europa Index Criteria .....	12
Handelsbanken Global Dynamisk Strategi .....	18
Handelsbanken Global High Dividend Low Volatility Criteria .....	22
Handelsbanken Global Index Criteria .....	27
Handelsbanken Global Momentum .....	41
Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria .....	46
Handelsbanken Norden Index Criteria .....	62
Handelsbanken Norge Index Criteria .....	68
Handelsbanken Sverige 100 Index Criteria .....	72
Handelsbanken Sverige Index Criteria .....	76
Handelsbanken USA Index Criteria .....	81

## Blandfonder

Handelsbanken Auto 25 Criteria .....	87
Handelsbanken Auto 50 Criteria .....	89
Handelsbanken Auto 75 Criteria .....	92
Handelsbanken Auto 100 Criteria .....	95
Handelsbanken Pension 40 .....	97
Handelsbanken Pension 50 .....	100
Handelsbanken Pension 60 .....	103
Handelsbanken Pension 70 .....	106
Handelsbanken Pension 80 .....	109
Handelsbanken Pension 90 .....	112

## Räntefonder

Handelsbanken Realränta .....	115
-------------------------------	-----

## Börshandlade fonder

XACT BEAR (ETF) .....	117
XACT BEAR 2 (ETF) .....	119
XACT BULL (ETF) .....	121
XACT BULL 2 (ETF) .....	123
XACT Norden (UCITS ETF) .....	125
XACT Nordic High Dividend Low Volatility (UCITS ETF) .....	128
XACT Obligation (UCITS ETF) .....	131
XACT OMXC25 (UCITS ETF) .....	133
XACT OMXS30 ESG (UCITS ETF) .....	136
XACT Svenska Småbolag (UCITS ETF) .....	139
XACT Sverige (UCITS ETF) .....	142

Information från Handelsbanken Fonder AB .....	145
--	-----

Definitioner .....	147
--------------------	-----



# Handelsbanken Emerging Markets Index

## Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Emerging Markets Index NTR så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet kommer att efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet av de aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,5%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet är återinvesterande, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet, justerat för skatt. Fonden placerar i stora och medelstora bolag i Asien, Latinamerika, Östeuropa och Afrika. Hållbarhetskraven i indexet syftar till en minskning av koldioxidutsläppen och bolagen i index väljs ut och viktas på så sätt att indexportföljens utsläpp av växthusgaser anpassas till de långsiktiga globala uppvärmningsmålen i Parisavtalet. Hållbarhetskraven i index innebär vidare att bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer, bolag som avsevärt skadar miljömässiga mål samt bolag som är verksamma inom kontroversiella sektorer inte ingår i index. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 9,3% under första halvåret 2023\*. De tre största aktieinnehaven vid halvårsskiftet var Taiwan Semiconductor, Samsung Electronics och Tencent Holdings. De tre största sektorerna var IT, finans och sällanköpsvaror. Av fondens tillgångar vid årsskiftet var 81% placerade i asiatiska bolag, 9% i afrikanska bolag och Mellanöstern 8% i latinamerikanska bolag och 2% i europeiska bolag. Fonden följer ett index som är i linje med Parisavtalets klimatmål så kallat EU Paris Aligned Benchmarks. Denna utveckling är ett viktigt steg på vägen att nå fondbolagets mål om nettooutsläpp i våra portföljer till år 2040 samt att linjera allt vårt förvaltade kapital i enlighet med Parisavtalets målsättningar.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Asien inklusive Mellanöstern, Latinamerika, Afrika samt Östeuropa. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker dock i företag i flera sektorer eller branscher vilket över tid bidrar till att minska risken i fonden. Då fondens investeringar sker i utländska aktier denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. Då fonden består av olika andelsklasser kan förändringar i valutakurser medföra att riskklassificeringen skiljer sig åt mellan olika andelsklasser beroende på vilken valuta andelsklassen handlas i. Fondens placeringsinriktning innebär exponering mot marknader där likviditeten ofta är lägre och variationen i likviditet bedöms vara förhöjd, jämfört med mer utvecklade marknader. Detta kan påverka fondens möjligheter att hantera stora utflöden till en begränsad kostnad. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på

fondens riskprofil. Investeringar på tillväxtmarknader kan innebära ökad exponering för operativa risker såsom risken att oförutsedda politiska beslut, risker till följd av brister i den finansiella infrastrukturen eller svagheter i ett lands eller regions värdepappersreglering. Operativa risker kan om de materialiseras påverka fondens utveckling och värde negativt.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

• Högsta hävstång under räkenskapsåret	1,5%
• Lägsta hävstång under räkenskapsåret	0,3%
• Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret	0,8%

## Information

Efter Rysslands invasion av Ukraina i slutet av februari 2022 togs beslut att sälja av alla ryska innehav. Försäljning av ryska innehav har dock inte varit möjligt då den ryska börsen varit stängd för utländska investerare. Ryska innehav samt ryska rubel (RUB) är för närvarande värderade till nära noll.

Fondens avkastningshistorik före startdatum härleds från fusionen (14 december 2018) då Handelsbanken Funds MSCI Emerging Markets Index (Luxemburg) lades samman med Handelsbanken Emerging Markets Index (Sverige).

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är

Handelsbanken Emerging Markets Index, forts.

uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

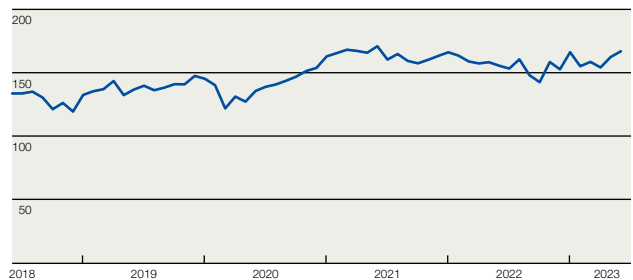
Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets

Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

### Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

### Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
<b>Andelsvärde, SEK</b>										
Emerging Markets Index A1 - SEK	188,88	172,78	184,73	174,09	166,95	135,19	-	-	-	-
Emerging Markets Index A1 - EUR	16,03	15,54	17,94	17,33	15,89	13,34	-	-	-	-
Emerging Markets Index A1 - NOK	187,35	163,36	179,92	181,50	156,71	132,04	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - SEK	192,94	176,15	187,57	176,07	168,16	135,63	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - EUR	16,37	15,84	18,22	17,52	16,00	13,38	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - NOK	191,37	166,54	182,69	183,56	157,86	132,47	-	-	-	-
Emerging Markets Index B1 - SEK	133,33	126,41	140,28	137,03	136,40	112,92	-	-	-	-
<b>Fondens totala nettoflöde, mnSEK</b>										
	778	1 831	322	1 476	1 068	61	-	-	-	-
<b>Fondförmögenhet totalt, mnSEK</b>										
Emerging Markets Index A1 - SEK	9 787	8 218	6 966	6 291	4 597	2 831	-	-	-	-
Emerging Markets Index A1 - EUR	7 361	6 165	4 838	3 665	1 668	1 186	-	-	-	-
Emerging Markets Index A1 - NOK	77	59	40	38	37	39	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - SEK	283	214	162	21	14	13	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - EUR	793	749	853	1 694	2 370	1 222	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - NOK	9	22	32	33	7	2	-	-	-	-
Emerging Markets Index B1 - SEK	324	90	312	180	82	0	-	-	-	-
Emerging Markets Index B1 - SEK	1	84	47	23	0	0	-	-	-	-
<b>Antal andelar totalt, tusental</b>										
Emerging Markets Index A1 - SEK	51 682	47 622	37 667	36 030	27 428	20 914	-	-	-	-
Emerging Markets Index A1 - EUR	38 969	35 679	26 190	21 051	9 992	8 775	-	-	-	-
Emerging Markets Index A1 - NOK	4 830	3 782	2 227	2 210	2 310	2 909	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - SEK	1 512	1 312	900	114	87	96	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - EUR	4 109	4 250	4 549	9 622	14 091	9 010	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - NOK	561	1 394	1 758	1 887	426	120	-	-	-	-
Emerging Markets Index B1 - SEK	1 691	542	1 708	980	519	0	-	-	-	-
Emerging Markets Index B1 - SEK	9	663	336	165	3	4	-	-	-	-
<b>Total avkastning i %</b>										
Emerging Markets Index A1 - SEK	9,3	-6,5	6,1	4,3	23,5	-9,5	22,5	18,6	-8,9	17,7
Emerging Markets Index A1 - EUR	3,2	-13,4	3,6	9,0	19,1	-12,2	19,4	13,4	-5,8	10,0
Emerging Markets Index A1 - NOK	14,7	-9,2	-0,9	15,8	18,7	-11,5	29,2	7,1	-0,1	19,4
Emerging Markets Index A9 - SEK	9,5	-6,1	6,5	4,7	24,0	-9,1	23,2	19,3	-8,4	18,4
Emerging Markets Index A9 - EUR	3,4	-13,1	4,0	9,5	19,6	-11,8	20,0	14,1	-5,2	10,6
Emerging Markets Index A9 - NOK	14,9	-8,8	-0,5	16,3	19,2	-11,2	29,9	7,7	0,4	20,1
Emerging Markets Index B1 - SEK	9,3	-6,4	6,1	4,4	23,5	-9,4	22,6	18,7	-8,9	17,8
<b>Jämförelseindex inklusive utdelning i %</b>										
Emerging Markets Index A1 - SEK	9,7	-5,7	7,3	4,9	25,0	-8,1	23,5	19,8	-8,4	19,2
Emerging Markets Index A1 - EUR	3,5	-12,7	4,7	9,7	20,6	-10,8	20,4	14,5	-5,2	11,4
Emerging Markets Index A1 - NOK	15,0	-8,5	0,2	16,5	20,2	-10,1	30,2	8,1	0,4	20,9
Emerging Markets Index A9 - SEK	9,7	-5,7	7,3	4,9	25,0	-8,1	23,5	19,8	-8,4	19,2
Emerging Markets Index A9 - EUR	3,5	-12,7	4,7	9,7	20,6	-10,8	20,4	14,5	-5,2	11,4
Emerging Markets Index A9 - NOK	15,0	-8,5	0,2	16,5	20,2	-10,1	30,2	8,1	0,4	20,9
Emerging Markets Index B1 - SEK	9,7	-5,7	7,3	4,9	25,0	-8,1	23,5	19,8	-8,4	19,2
<b>Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)</b>										
Emerging Markets Index A1 - SEK	0,2	0,2	0,2	0,3	0,4	0,4	0,3	0,6	0,6	-
Emerging Markets Index A1 - EUR	0,2	0,2	0,2	0,3	0,4	0,4	-	-	-	-
Emerging Markets Index A1 - NOK	0,2	0,2	0,2	0,3	0,4	0,4	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - SEK	0,2	0,2	0,2	0,3	0,4	0,4	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - EUR	0,2	0,2	0,2	0,3	0,4	0,4	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - NOK	0,2	0,2	0,2	0,3	0,4	0,4	-	-	-	-
Emerging Markets Index B1 - SEK	0,2	0,2	0,2	0,3	0,4	0,4	-	-	-	-
<b>Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %</b>										
Emerging Markets Index A1 - SEK	-1,2	-0,4	5,2	13,5	5,7	5,3	20,6	4,0	3,5	-
Emerging Markets Index A1 - EUR	-8,3	-5,3	6,3	14,0	2,3	2,4	16,4	3,4	1,8	-
Emerging Markets Index A1 - NOK	-1,9	-5,1	7,1	17,2	2,5	6,9	17,6	3,4	9,2	-
Emerging Markets Index A9 - SEK	-0,8	0,0	5,6	13,9	6,1	5,8	21,2	4,6	4,2	-
Emerging Markets Index A9 - EUR	-7,9	-4,9	6,7	14,4	2,7	2,9	17,0	4,0	2,4	-
Emerging Markets Index A9 - NOK	-1,5	-4,7	7,6	17,7	2,9	7,4	18,3	4,0	9,8	-
Emerging Markets Index B1 - SEK	-1,2	-0,4	5,3	13,6	5,7	5,4	20,6	4,0	3,6	-

Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %

Handelsbanken Emerging Markets Index, forts.

SEK	-0,3	0,6	6,1	14,5	7,2	6,6	21,6	4,8	4,5	-
EUR	-7,5	-4,4	7,2	15,0	3,7	3,6	17,4	4,2	2,7	-
NOK	-1,0	-4,2	8,0	18,3	3,9	8,2	18,7	4,2	10,2	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Emerging Markets Index A1 - SEK	4,5	3,0	8,7	11,1	8,2	7,1	-	-	-	-
Emerging Markets Index A1 - EUR	2,0	0,5	7,1	9,1	5,9	4,3	-	-	-	-
Emerging Markets Index A1 - NOK	6,3	1,8	9,3	11,0	7,7	7,8	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - SEK	5,0	3,4	9,1	11,6	8,7	7,7	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - EUR	2,5	0,9	7,6	9,6	6,5	4,8	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - NOK	6,8	2,2	9,7	11,5	8,3	8,4	-	-	-	-
Emerging Markets Index B1 - SEK	4,6	3,0	8,7	11,2	8,2	7,2	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	5,6	4,0	9,8	12,3	9,3	8,3	-	-	-	-
EUR	3,1	1,5	8,3	10,2	7,0	5,4	-	-	-	-
NOK	7,4	2,9	10,4	12,1	8,8	9,0	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %										
Emerging Markets Index A1 - SEK	7,2	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Emerging Markets Index A1 - EUR	4,1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Emerging Markets Index A1 - NOK	8,2	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - SEK	7,7	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - EUR	4,6	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Emerging Markets Index A9 - NOK	8,7	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Emerging Markets Index B1 - SEK	7,3	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	8,3	-	-	-	-	-	-	-	-	-
EUR	5,1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NOK	9,3	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK	4,48	4,76	5,24	4,77	2,82	-	-	-	-	-
Omräkningskurs EUR/SEK	11,78	11,12	10,30	10,05	10,51	10,13	-	-	-	-
Omräkningskurs NOK/SEK	1,01	1,06	1,03	0,96	1,07	1,02	-	-	-	-

Historiskt kan fonden ha haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta - historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Emerging Markets  
T o m 2019-05-09: MSCI EM Select Global Norms Ex Controversial Business  
T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Emerging Markets Index

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Emerging Markets Index A1	0,60
Emerging Markets Index A9	0,20
Emerging Markets Index B1	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Emerging Markets Index A1	0,60
Emerging Markets Index A9	0,20
Emerging Markets Index B1	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Emerging Markets Index A1	0,62
Emerging Markets Index A9	0,22
Emerging Markets Index B1	0,62
Transaktionskostnader, tSEK	6 043
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,09

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,2
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	0,0
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk % - A1 SEK	15,8	Aktiv avkastning % - B1 SEK	-0,9
Total risk % - A1 EUR	14,4	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk % - A1 NOK	14,6	Informationskvot - A1 EUR	Negativ
Total risk % - A9 SEK	15,8	Informationskvot - A1 NOK	Negativ
Total risk % - A9 EUR	14,4	Informationskvot - A9 SEK	Negativ
Total risk % - A9 NOK	14,6	Informationskvot - A9 EUR	Negativ
Total risk % - B1 SEK	15,8	Informationskvot - A9 NOK	Negativ
Total risk i index % - A1 SEK	15,8	Informationskvot - B1 SEK	Negativ
Total risk i index % - A1 EUR	14,4	Sharpekvot - A1 SEK	-0,1
Total risk i index % - A1 NOK	14,5	Sharpekvot - A1 EUR	-0,6
Total risk i index % - A9 SEK	15,8	Sharpekvot - A1 NOK	-0,2
Total risk i index % - A9 EUR	14,4	Sharpekvot - A9 SEK	-0,1
Total risk i index % - A9 NOK	14,5	Sharpekvot - A9 EUR	-0,6
Total risk i index % - B1 SEK	15,8	Sharpekvot - A9 NOK	-0,2
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG	Sharpekvot - B1 SEK	-0,1
	Screened Paris Aligned	Sharpekvot i index - A1 SEK	-0,1
	Emerging Markets	Sharpekvot i index - A1 EUR	-0,6
Aktiv avkastning % - A1 SEK	-0,9	Sharpekvot i index - A1 NOK	-0,2
Aktiv avkastning % - A1 EUR	-0,8	Sharpekvot i index - A9 SEK	-0,1
Aktiv avkastning % - A1 NOK	-0,9	Sharpekvot i index - A9 EUR	-0,6
Aktiv avkastning % - A9 SEK	-0,5	Sharpekvot i index - A9 NOK	-0,2
Aktiv avkastning % - A9 EUR	-0,5	Sharpekvot i index - B1 SEK	-0,1
Aktiv avkastning % - A9 NOK	-0,5		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	9 704 017	99,2	8 150 376	99,2
OTC-derivatinstrument med positivt marknadsvärde	5	0,0	-	-
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>9 704 023</b>	<b>99,2</b>	<b>8 150 376</b>	<b>99,2</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	70 333	0,7	55 086	0,7
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	39 772	0,4	16 918	0,2
Övriga tillgångar	21 603	0,2	-	-
<b>Summa tillgångar</b>	<b>9 835 731</b>	<b>100,5</b>	<b>8 222 380</b>	<b>100,0</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	4 523	0,0	3 946	0,0
Övriga skulder	44 054	0,5	-	-
<b>Summa skulder</b>	<b>48 577</b>	<b>0,5</b>	<b>3 946</b>	<b>0,0</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>9 787 153</b>	<b>100,0</b>	<b>8 218 435</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	420 390	4,3	443 494	5,4
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	462 581	4,7	475 718	5,8
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	2 612	0,0	2 096	0,0

1) Likvida medel 2 612 tSEK

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES** **99,2**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>BRASILIEN</b>			
Atacadao Carrefour	123 200	3 090	0,0
B3 Brasil Bolsa Balcao	522 200	17 083	0,2
Banco Bradesco	339 783	11 138	0,1
Banco Bradesco Pref	943 721	34 760	0,4
Banco BTG Pactual	181 500	12 781	0,1
Banco do Brasil	228 600	25 286	0,3
Banco Santander Brasil	63 400	4 348	0,0
BB Seguridade Participacoes	123 900	8 536	0,1
CCR	487 400	15 333	0,2
Cemig Cia Energy	187 200	5 390	0,1
CPFL Energia	71 300	5 490	0,1
Energisa	122 700	13 792	0,1
Equatorial Energia	104 600	7 530	0,1
Gerdau Pref	18 330	1 029	0,0
Hapvida	387 670	3 802	0,0
Hypermarcas	2 200	227	0,0
Itaú Unibanco Holding Pref	779 800	49 622	0,5
Itaúsa	707 668	15 275	0,2

Handelsbanken Emerging Markets Index, forts.

	Antal/Nom. bel. tusenl	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusenl	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
Klabin	133 300	6 498	0,1	Bajaj Finserv	162 068	32 605	0,3
Localiza Rent a Car (Rent3)	74 749	11 465	0,1	Bajaj Holdings And Investment	325	300	0,0
Lojas Renner	193 707	8 674	0,1	Bandhan Bank	18 451	588	0,0
Magazine Luiza N	655 300	4 945	0,1	Bank of Baroda	281 259	7 049	0,1
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios	153 600	9 516	0,1	Berger Paints India	1 106	99	0,0
Natura & Co Holding	403 740	15 133	0,2	Bharti Airtel	424 354	49 098	0,5
Nu Holdings A	48 400	4 125	0,0	Biocor	150 804	5 272	0,1
Rede Dor Sao Lui	44 700	3 295	0,0	Bosch	2 489	6 240	0,1
Rumo	403 200	20 042	0,2	Britannia Industries	7 068	4 676	0,0
Sabesp	49 200	6 232	0,1	Cholaman Invest	774	116	0,0
Sendas Distribuidora	14 400	443	0,0	Cipla	94 975	12 692	0,1
Siderúrgica Nacional	8 300	225	0,0	Colgate-Palmolive India	22 194	4 933	0,1
Suzano	168 357	16 669	0,2	Container Corporation Of India	115 958	10 104	0,1
Telefonica Brasil	45 000	4 360	0,0	Crompton Greaves	37 715	1 880	0,0
WEG	285 000	24 090	0,2	Cummins India	133 510	34 157	0,3
		<b>370 223</b>	<b>3,8</b>	Dabur	20 258	1 528	0,0
<b>CAYMANÖARNAN</b>				Dalmia Bharat	18 951	5 405	0,1
Kingssoft	89 000	3 784	0,0	Divi's Laboratories	28 708	13 545	0,1
Li Auto A	290 375	54 231	0,6	DLF	229 520	14 824	0,2
PagSeguro A	35 200	3 589	0,0	Dr. Reddy's Laboratories	21 522	14 621	0,1
PDD Holdings ADR	121 700	90 886	0,9	Eicher Motors	36 978	17 430	0,2
StoneCo A	18 400	2 532	0,0	Embassy Office	171 186	6 574	0,1
XP A	30 000	7 602	0,1	Godrej Consumer Products	75 550	10 753	0,1
Zhen Ding Technology	87 000	3 168	0,0	Godrej Prop	8 590	1 774	0,0
		<b>165 792</b>	<b>1,7</b>	Havells India	47 249	7 980	0,1
<b>CHILE</b>				HCL Technologies	161 743	25 298	0,3
Banco Santander Chile	1 852 482	946	0,0	HDFC Asset Management	9 544	2 885	0,0
CMPC	481 666	9 949	0,1	HDFC Standard	48 900	4 193	0,0
Enel Americas	2 057 238	2 964	0,0	Hero Motocorp	6 970	2 671	0,0
Enel Chile	5 131 161	3 600	0,0	Hindustan Unilever	119 231	42 043	0,4
S.A.C.I. Falabella	255 576	6 625	0,1	Honeywell Automation India	131	719	0,0
Sociedad Química y Minera	20 210	15 892	0,2	Housing Development Finance	231 554	86 034	0,9
		<b>39 977</b>	<b>0,4</b>	ICICI Bank	629 596	77 474	0,8
<b>COLOMBIA</b>				ICICI Lombard General Insurance	32 290	5 716	0,1
Bancolombia	40 336	3 234	0,0	ICICI Prudential Life Insurance	88 039	6 636	0,1
Bancolombia Pref	60 667	4 392	0,0	IDFC First Bank	10 881	114	0,0
Interconexión Eléctrica	67 412	2 945	0,0	Indus Towers	28 516	617	0,0
		<b>10 572</b>	<b>0,1</b>	Info Edge India	861	508	0,0
<b>EGYPTEN</b>				Infosys Technologies	492 816	86 656	0,9
Commercial International Bank	649 324	7 995	0,1	Interglobe Avia	25 257	8 736	0,1
Commercial International Bank Egypt	3 000	53	0,0	Kotak Mahindra Bank	147 426	35 843	0,4
		<b>8 049</b>	<b>0,1</b>	L&T Technology Services	3 699	1 917	0,0
<b>FILIPPINERNA</b>				Linde India	3 008	1 710	0,0
Ayala Land	1 145 021	5 445	0,1	LTIMindtree	7 113	4 867	0,0
BDO Unibank	164 604	4 435	0,0	Lupin Laboratories	65 763	7 817	0,1
Globe Telecom	6 047	2 048	0,0	Macrotech Developers	257 600	23 057	0,2
International Container Terminal Services	347 320	13 851	0,1	Mahindra & Mahindra	152 374	29 163	0,3
Jollibee Foods	9 167	429	0,0	Marico	157 775	11 030	0,1
Metrobank	118 131	1 288	0,0	Maruti Suzuki India	18 706	24 110	0,2
SM Investments	44 535	8 061	0,1	MRF	355	4 733	0,0
SM Prime Holdings	769 953	4 949	0,1	Nestle India	5 476	16 507	0,2
Universal Robina	382 205	10 283	0,1	NHPC	2 049 831	12 401	0,1
		<b>50 789</b>	<b>0,5</b>	One 97 Communications	334 187	38 186	0,4
<b>FÖRENADE ARABEMIRATEN</b>				Page Industries	1 206	5 978	0,1
Abu Dhabi Commercial Bank	611 462	14 583	0,1	PI Industries	664	343	0,0
Aldar	123 298	1 846	0,0	Pidlite Industries	20 779	7 105	0,1
Dubai Islamic Bank	167 910	2 701	0,0	Power Finance	83 387	2 370	0,0
Emaar Properties	25 506	481	0,0	Power Grid Corporation of India	608 551	20 444	0,2
Emirates	125 305	5 472	0,1	Rural Electrification	105 014	2 277	0,0
International Holdings	48 343	56 012	0,6	Samvardhana Motherson	1 093 420	12 338	0,1
National Bank of Abu Dhabi	711 880	28 554	0,3	SBI Cards	59 984	6 691	0,1
		<b>109 648</b>	<b>1,1</b>	Sbilife Equity	39 924	6 870	0,1
<b>GREKLAND</b>				Shree Cement	3 993	12 558	0,1
Eurobank Ergasias	424 065	7 541	0,1	Shriram Finance	1 337	305	0,0
Hellenic Telecom	55 023	10 186	0,1	Siemens India	38 741	19 212	0,2
Jumbo	52 342	15 544	0,2	SRF	810	244	0,0
National Bank of Greece	23 652	1 660	0,0	State Bank of India	308 690	23 283	0,2
Piraeus Financial Holdings	101 468	3 594	0,0	Sun Pharmaceutical	198 776	27 522	0,3
Terna Energy	26 908	6 405	0,1	Tata Communications	18 195	3 820	0,0
		<b>44 930</b>	<b>0,5</b>	Tata Consultancy Services	135 110	58 745	0,6
<b>HONGKONG</b>				Tata Global Beverages	97 983	11 106	0,1
Beijing Enterprises Water Group	1 036 385	2 657	0,0	Tata Motors	423 048	33 172	0,3
BOC Hong Kong Holdings	709 000	23 405	0,2	Tata Motors DVR	465 453	19 124	0,2
China Everbright	47 888	204	0,0	Tech Mahindra	89 190	13 280	0,1
China Merchants Port Holding	324 000	4 939	0,1	Titan Industries	37 214	14 933	0,2
China Overseas Land & Investment	975 000	22 953	0,2	Torrent Pharmaceuticals	20 290	5 089	0,1
China Resources Cement	20 000	89	0,0	TVS Motor	28 276	4 935	0,1
China Resources Land	566 898	25 941	0,3	United Phosphorus	164 242	14 868	0,2
Franshion Properties China	1 464 000	2 321	0,0	Volta DS	3 194	320	0,0
Orient Overseas	1 000	145	0,0	Wipro	180 897	9 269	0,1
Silicon Motion Technology ADR	15 800	12 264	0,1	WNS ADR	5 200	4 141	0,0
		<b>94 917</b>	<b>1,0</b>	Yes Bank	2 437 892	5 216	0,1
<b>INDIEN</b>				Zydu Lifesciences	147 298	11 308	0,1
ABB India	35 022	20 395	0,2		<b>1 369 583</b>	<b>14,0</b>	
ACC	25 395	6 064	0,1	<b>INDONESIEN</b>			
Adani Green Energy	95 227	11 860	0,1	Aneka Tambang	208 500	293	0,0
Adani Ports and Special Economic Zone	175 517	17 084	0,2	Bank Artos Indonesia	2 880 700	6 600	0,1
Alkem Laboratories	404	187	0,0	Bank Central Asia	8 460 200	55 770	0,6
Ambuja Cements	120 453	6 755	0,1	Bank Mandiri	5 628 600	21 087	0,2
Apollo Hospitals Enterprise	2 792	1 874	0,0	Bank Negara Indonesia	1 220 500	8 046	0,1
Ashok Leyland	58 172	1 282	0,0	Bank Rakyat Indonesia	8 320 623	32 521	0,3
Asian Paints	67 017	29 666	0,3	Barito Pacific	8 741 947	4 692	0,0
AU Small Finance Bank	1 848	183	0,0	Chandra Asri Petrochemical	4 810 800	7 278	0,1
Aurobindo Pharma	105 596	10 113	0,1	Charoen Pokphand	2 416 200	9 182	0,1
Avenue Supermarts	21 891	11 210	0,1	Elang Mahkota Teknologi	4 812 900	2 462	0,0
Axis Bank	242 841	31 572	0,3	Indah Kiat Pulp & Paper	176 500	1 081	0,0
Bajaj Auto	22 842	14 110	0,1	Indocement Tunggal Prakarsa	312 100	2 232	0,0
Bajaj Finance	25 965	24 480	0,3	Indofood CBP	851 600	6 948	0,1
				Indosat	245 400	1 525	0,0
				Kalbe Farma	10 658 100	15 741	0,2
				Merdeka Copper	12 200	27	0,0
				PT GoTo Gojek Tokopedia	60 729 900	4 813	0,0

Handelsbanken Emerging Markets Index, forts.

	Antal/Nom. bel. tusenl	Marknads- värde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusenl	Marknads- värde ISEK	% av fondförm.
Sarana Menara Nusan	337 500	257	0,0	CSC Financial H	432 500	4 817	0,0
Semen Indonesia	670 401	2 934	0,0	Dali Foods Group	703 000	3 391	0,0
Telkom Indonesia	6 807 100	19 617	0,2	DFZQ H	86 000	509	0,0
Unilever Indonesia	1 427 200	4 380	0,0	Dongfang Electrical Machinery	20 600	285	0,0
		<b>207 485</b>	<b>2,1</b>	Dongfeng Motor	124 400	614	0,0
KINA				Ecovacs Robotics A	3 300	382	0,0
360 Security Technology A	16 300	304	0,0	EVE Energy A	14 036	1 263	0,0
37 Interactive Entertainment	13 300	690	0,0	Everbright Securities A	4 800	113	0,0
Agricultural Bank of China	3 944 999	16 747	0,2	Fangda Carbon New Materia A	174 800	1 612	0,0
Agricultural Bank of China A	121 800	639	0,0	Faw Car A	159 200	1 981	0,0
Air China	531 103	4 085	0,0	Flat Glass Group A	11 700	670	0,0
Air China A	57 400	703	0,0	Flat Glass Group H	63 000	2 323	0,0
Alibaba Group Holding	2 403 900	269 042	2,7	Focus Media A	33 800	342	0,0
Amlogic (Shanghai) A	25 307	3 173	0,0	Foshan Hai Tian Flavouring & Food A	40 906	2 850	0,0
Amperex Tech A	22 140	7 532	0,1	Foxconn Industrial Internet A	52 000	1 949	0,0
Angang New Steel	312 000	882	0,0	Fujian Sunner De A	40 500	1 153	0,0
Anhui Conch A	19 200	678	0,0	Full Truck Alliance	88 700	5 959	0,1
Anhui Conch Cement HKD	8 800	252	0,0	Future Land Holdings	57 700	1 236	0,0
Anta Sports	192 200	21 206	0,2	Fuyao Glass Industry Group	51 800	2 313	0,0
Asymchem Laboratories A	10 240	1 795	0,0	Ganfeng Lithium Group A	17 880	1 621	0,0
Autohome	1 600	504	0,0	Ganfeng Lithium Group H	42 279	2 978	0,0
Avary Holding (Shenzhen) A	8 200	296	0,0	GDS Holding Sp ADS A	14 500	1 721	0,0
Avic Industry Finance Holding	32 700	186	0,0	Gemdale A	11 500	123	0,0
Baidu ADR	42 400	62 701	0,6	Genscript Biotech	690 000	16 738	0,2
Bank of China	12 848 700	55 608	0,6	GF Securities	190 863	2 846	0,0
Bank of Communications	1 470 396	10 518	0,1	GF Securities A	2 700	59	0,0
Bank Of Nanjing A	41 400	492	0,0	GigaDevice Semiconductor	13 624	2 152	0,0
Bank of Shanghai A	9 000	77	0,0	GoerTek A	90 900	2 399	0,0
Baoshan Iron & Steel A	114 200	954	0,0	Goldwind H	466 200	3 451	0,0
BBMG A	155 400	504	0,0	Gotion High-tech A	700	29	0,0
Beijing Dabeinong Technology Group A	6 200	61	0,0	Greentown China	174 500	1 888	0,0
Beijing New Building Materials Public A	700	26	0,0	Guangdong Haid Group A	97 600	6 798	0,1
Beijing Roborock Technology A	9 339	4 453	0,0	Guangdong Kinlong Hardware	200	19	0,0
Beijing Shiji Information Technology A	290 420	6 046	0,1	Guangzhou Automobile Group	890 999	5 735	0,1
Beijing-Shanghai High Speed Railway A	1 302 000	10 183	0,1	Guangzhou Pharmaceutical	120 000	3 912	0,0
Betta Pharma A	2 600	186	0,0	Guangzhou Pharmaceutical S	10 500	498	0,0
BGI Genomics A	600	54	0,0	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology	19 900	1 978	0,0
Bk of Comm A	61 600	531	0,0	Guangzhou Tinci Materials	600	37	0,0
BOE Technology A	427 300	2 599	0,0	Guosen Securities A	1 700	22	0,0
By-Health A	196 900	7 021	0,1	Guotai Junan Securities A	1 100	23	0,0
BYD	100 800	34 734	0,4	Guotai Junan Securities H	32 200	408	0,0
BYD A	35 000	13 441	0,1	H World Group ADR	29 600	12 399	0,1
CanSino Biologics	1 200	43	0,0	Haier Smart Home A	85 000	2 968	0,0
CanSino Biologics A	1 573	191	0,0	Haier Smart Home H	190 200	6 462	0,1
Changchun High & New Technology Industry	17 000	3 445	0,0	Haitong Securities	322 000	2 130	0,0
Changjiang Securities A	29 800	257	0,0	Han's Laser Technology A	30 000	1 169	0,0
Changzhou Xingyu Automotive A	300	55	0,0	Hangzhou First Applied Materia A	11 760	650	0,0
Chaoshou Three A	4 300	188	0,0	Hansoh Pharma	216 000	3 751	0,0
China Citic Bank	1 406 000	7 132	0,1	HBIS A	72 400	243	0,0
China Conch Venture	278 600	3 917	0,0	Henan Shuanghui Invest & Dev A	10 000	364	0,0
China Construction Bank	13 605 400	95 075	1,0	Hengan International	113 345	5 155	0,1
China Cosco Holdings	200 149	1 948	0,0	Hengrui Medic A	94 954	6 763	0,1
China CSSC Holdings A	42 100	2 060	0,0	Hengyi Petrochemical A	93 590	944	0,0
China Eastern Airlines	336 000	1 227	0,0	Hua Hong Semiconductor	136 000	4 799	0,0
China Eastern Airlines A	109 300	774	0,0	Huadong Medicine A	3 200	206	0,0
China Everbright Bank A	35 000	160	0,0	Huaxi Securities A	45 300	560	0,0
China Everbright Bank H	836 000	2 593	0,0	Huaxin Cement A	1 800	33	0,0
China Feihe	415 000	2 494	0,0	Huayu Automotive Systems A	76 000	2 086	0,0
China Galaxy Securities A	24 700	426	0,0	Ilytek A	650	66	0,0
China Galaxy Securities H	592 400	3 413	0,0	Industrial & Commercial Bank of China HKD	10 281 000	59 232	0,6
China Greatwall Technology Group A	90 700	1 865	0,0	Industrial Bank A	32 800	763	0,0
China Hongqiao Group	56 000	491	0,0	Inner Mongolia A	77 300	3 255	0,0
China Int Marine Containers	131 340	1 346	0,0	Inner Mongolia Baotou Steel Union A	351 200	935	0,0
China International Capital H	17 200	326	0,0	Innovent Bio	104 500	4 263	0,0
China Jushi A	83 689	1 762	0,0	Inspur Electronic Information Industry	98 500	7 104	0,1
China Lesso Group	76 000	538	0,0	iQIYI Sp ADR A	500	29	0,0
China Life Insurance A	17 500	910	0,0	JA Solar Technology A	26 544	1 646	0,0
China Life Insurance HKD	1 351 700	24 332	0,2	Jafron Biomedical A	16 540	570	0,0
China Literature	157 400	7 148	0,1	JD Health International	26 150	1 782	0,0
China Merch Shekou A	146 100	2 831	0,0	JD Logistics	739 800	12 460	0,1
China Merchants Bank	633 401	31 080	0,3	JD.com ADR	136 900	50 468	0,5
China Mercht Bk A	184 500	8 987	0,1	Jgsu Yuyue Med A	13 000	696	0,0
China Minsheng Banking	1 519 019	6 072	0,1	Jiangsu Hengli Hydraulic A	21 900	2 095	0,0
China Molybdenum	1 692 000	9 562	0,1	Jiangxi Copper HKD	54 000	896	0,0
China Molybdenum A	104 300	827	0,0	Jonjee Hi-Tech Indust and Commercial	76 900	4 207	0,0
China National Building Material	69 414	461	0,0	Juwei Food A	300	17	0,0
China National Chemical Engineering A	176 400	2 172	0,0	KE Holdings	135 600	21 750	0,2
China National Nuclear Power A	325 300	3 410	0,0	Kingdee International Software Group	204 000	2 947	0,0
China Northern Rare Earth High-Tech	130 500	4 653	0,0	Kuaishou Technology Prep	253 700	18 725	0,2
China Pacific A	5 300	205	0,0	Kuang-Chi Technologies A	1 500	34	0,0
China Pacific Insurance	514 621	14 364	0,1	LB Group A	196 200	4 814	0,0
China Railway Group	1 036 000	7 382	0,1	Lenovo Group HKD	1 823 236	20 531	0,2
China Railway Group A	329 400	3 713	0,0	Lens Technology A	71 300	1 247	0,0
China Resources Mixc Lifestyle Services	18 400	987	0,0	Lepu Medical Technology Beijing A	12 400	417	0,0
China Securities A	154 500	5 560	0,1	Li Ning	498 000	28 932	0,3
China Southern A	89 700	804	0,0	Lingyi Itch (Gua Aodong) A	36 400	374	0,0
China Southern Airlines	289 405	1 763	0,0	Longfor Properties	324 100	8 505	0,1
China Tower H	6 626 000	7 945	0,1	LONGi Green Energy Technology A	115 848	4 939	0,1
China Vanke A	152 700	3 183	0,0	Lufax Hldg ADR	334 500	5 167	0,1
China Vanke H	375 711	5 448	0,1	Luxshare Precision Industry A	81 729	3 944	0,0
China Yangtze Power A	229 100	7 515	0,1	Mango Excellent Media A	1 700	86	0,0
Chongqing Changan Automobile A	1 103 780	21 222	0,2	Maxscend A	1 920	276	0,0
Chongqing Rural	93 000	355	0,0	Meinian Onehealth Healthcare Holdings	9 200	97	0,0
Chongqing Rural A	110 000	587	0,0	Meituan B	827 250	139 448	1,4
Citic Securities A	27 715	815	0,0	Microport Scientific	33 000	644	0,0
Citic Securities H	462 335	9 049	0,1	Nari Technology A	1 555	53	0,0
CN Minsheng Bank A	50 000	279	0,0	NavInfo A	21 600	372	0,0
Cn state Cons Eng A	533 500	4 553	0,0	NetEase	195 975	41 220	0,4
Cosco Shipping Holdings A	203 810	2 849	0,0	New China Life Insurance H	71 523	2 036	0,0
Country Garden Holdings	2 031 532	4 452	0,0	New Hope Liuhe A	137 200	2 383	0,0
Country Garden Services Holding	26 000	363	0,0	New Oriental Education & Technology Group	60 400	25 763	0,3
Cq Zhifei Biolo A	21 750	1 429	0,0	Ninestar A	900	46	0,0

Handelsbanken Emerging Markets Index, forts.

	Antal/Nom. bel. tusenl	Marknads- värde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusenl	Marknads- värde ISEK	% av fondförm.
Ningbo Port A	493 930	2 490	0,0	Zhejiang Chint Electrics A	51 300	2 109	0,0
Ningbo Tuopu A	10 500	1 260	0,0	Zhejiang Dahua Technology A	53 900	1 583	0,0
NIO ADR 1 A	263 600	27 590	0,3	Zhejiang Expressway	348 000	2 854	0,0
Nongfu Spring H	152 600	9 097	0,1	Zhejiang Huahai A	36 700	1 005	0,0
O film Tech A	88 600	738	0,0	Zhejiang Huayou Cobalt A	260	18	0,0
Oppain Home GroupA	27 010	3 848	0,0	Zhejiang NHU A	90 432	2 071	0,0
Ovctek China A	2 240	101	0,0	Zhejiang Supor A	14 000	1 041	0,0
Pangang Group Vanadium Titanium & Resources	1 271 800	7 394	0,1	Zheshang Secur A	22 400	329	0,0
People's Insurance Company of China	3 900	34	0,0	ZhongAn Online P & C Insurance	78 300	2 299	0,0
People's Insurance Company of China HKD	1 462 900	5 726	0,1	Zhongji Innoli A	7 700	1 688	0,0
Perfect World A	16 050	403	0,0	Zhongsheng Group	176 000	7 265	0,1
Pharmaron Beijing	28 050	936	0,0	Zhuzhou CSR Times Electric	193 458	7 786	0,1
Pharmaron Beijing A	7 850	447	0,0	Zj Dingli Machi A	48 992	4 080	0,0
PICC Property and Casualty	1 078 490	12 947	0,1	Zoomlion	10 500	105	0,0
Ping An Bank	16 400	274	0,0	ZTE A	800	54	0,0
Ping An Insurance	809 100	55 592	0,6	ZTE H	879 380	38 059	0,4
Ping An Insurance A	67 100	4 630	0,0	ZTO Express Cayman ADR	88 700	24 029	0,2
Poly Property Development H	143 200	7 490	0,1			<b>2 531 274</b>	<b>25,9</b>
Postals Savings Bank of China	2 165 000	14 383	0,1	KUWAIT			
Red Star Macalline Group A	58 400	416	0,0	Agility Public Ware	492 984	10 794	0,1
RemeGen H	190 000	8 969	0,1	Boubyan Bank	446 699	10 047	0,1
Rongsheng Petro Chemical A	24 150	418	0,0	Mobile	520 324	9 472	0,1
S.F. Holding A	1 600	107	0,0	National Bank of Kuwait	1 238 270	40 688	0,4
SAIC Motor A	40 500	853	0,0			<b>71 001</b>	<b>0,7</b>
Sany Heavy Industry A	19 700	487	0,0	MALAYSIA			
Shandong Dong E E Jiao A	10 500	835	0,0	Axiata	550 386	3 375	0,0
Shandong Gold Mining H	23 650	465	0,0	Celcomdigi	58 500	556	0,0
Shandong Gold-Mining A	17 380	607	0,0	CIMB	555 605	6 506	0,1
Shandong Linglong Tyre A	10 800	357	0,0	Gamuda	185 700	1 891	0,0
Shandong Weigao Group	144 800	2 044	0,0	Hong Leong Bank	62 900	2 760	0,0
Shanghai Electric Group	1 969 000	4 966	0,1	Inari Amertron	4 700	30	0,0
Shanghai Electric Group A	241 500	1 641	0,0	IOI	618 815	5 341	0,1
Shanghai Fosun Pharmaceutical	260 192	7 495	0,1	Malayan Banking	351 300	7 016	0,1
Shanghai Fosun Pharmaceutical A	34 700	1 594	0,0	Malaysia Airports	217 167	3 458	0,0
Shanghai International Airport	30 500	2 060	0,0	Maxis	140 300	1 331	0,0
Shanghai International Port A	288 200	2 250	0,0	Mr D.I.Y. Group M	2 700	10	0,0
Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Dev	124 360	1 825	0,0	Nestle Malaysia	11 900	3 608	0,0
Shanghai M&G Stationery A	17 500	1 162	0,0	Petronas Chemicals Group	351 900	4 886	0,0
Shanghai Medicilon A	457	58	0,0	PPB Group	94 819	3 454	0,0
Shanghai MicroPort MedBot	178 500	5 979	0,1	Press Metal Aluminium Holding	978 500	10 643	0,1
Shanghai Pharmaceuticals Holding A	112 500	3 749	0,0	Public Bank	1 880 585	16 755	0,2
Shanghai Pudong Development Bank	122 300	1 317	0,0	QL Resources	245 200	3 041	0,0
Shanghai Raas Blood Products A	206 040	2 301	0,0	RHB Capital	3 559	45	0,0
Shanghai Yuyuan Tourist Mart A	411 800	4 201	0,0	Sime Darby	1 248 866	5 925	0,1
Shanxi Taigang Stainless Steel A	142 500	820	0,0	Sime Darby Plantation	722 397	6 938	0,1
Shengyi Technology A	16 300	344	0,0			<b>87 568</b>	<b>0,9</b>
Shennan Circuits A	11 100	1 244	0,0	MEXIKO			
Shenzhen Overseas Chinese Town A	44 400	290	0,0	Alfa	23 499	158	0,0
Shenzhou International Group Holdings	126 200	13 002	0,1	America Movil	4 114 300	48 196	0,5
Sichuan Chuantou Energy A	226 600	5 071	0,1	Arca Continental	228 700	25 341	0,3
Sinopharm Group	567 800	19 174	0,2	Banorte	504 900	44 902	0,5
Sinotrans A	113 500	786	0,0	Cemex	2 017 608	15 375	0,2
Sinotrans HKD	2 136 000	8 214	0,1	Controladora Axtel	23 499	3	0,0
Sinotruk Hong Kong	72 500	1 521	0,0	Fibra Uno Administracion	617 178	9 717	0,1
Skshu Paint	4 480	436	0,0	Gruma	87 436	15 131	0,2
Songcheng Performance Dev A	16 200	299	0,0	Grupo Aeroportuario del Pacifico	114 300	22 116	0,2
Sunny Optical Technology Group	130 319	14 037	0,1	Grupo Aeroportuario del Sureste	40 395	12 140	0,1
Sunwoda Elec A	13 500	328	0,0	Grupo Bimbo	494 100	28 520	0,3
Sz Inovance Tec A	11 700	1 117	0,0	Grupo Carso Series A1	24 700	1 934	0,0
Sz Mindray Bio-Medical Electronics A	1 500	669	0,0	Grupo Electra	14 655	10 680	0,1
TCL Technology A	7 700	45	0,0	Grupo Financiero Inbursa	627 100	16 058	0,2
TCL Zhonghuan Renewable Energy Tech	43 625	2 154	0,0	Grupo Televisa	593 500	6 582	0,1
Tencent	883 700	403 894	4,1	Industrias Peñoles	33 700	5 103	0,1
Tencent Music ADR	160 700	12 810	0,1	Kimberly-Clark de México	592 600	14 208	0,1
Tianma Microelectronics A	80 600	1 100	0,0	Orbia Advance	181 400	4 213	0,0
Tingyi Holdings	356 000	5 976	0,1	Walmart de México y Centroamérica	890 800	37 992	0,4
Toly Bread A	31 080	468	0,0			<b>318 373</b>	<b>3,3</b>
Tongcheng Travel Holdings	46 400	1 048	0,0	QATAR			
Tongkun Group A	53 200	1 048	0,0	Commercial Bank of Qatar	629 389	10 830	0,1
Tongwei	800	41	0,0	Industries Qatar	602 054	20 063	0,2
Topchoice Medical A	200	29	0,0	Masraf Al Rayan	574 019	4 366	0,0
Topsports International Holdings	24 000	225	0,0	Mesaieed Petrochemical Holding	1 428 128	8 052	0,1
Trina Solar A	220 979	14 001	0,1	Ooredoo	406 028	13 181	0,1
Trip.com Group ADR	101 300	38 296	0,4	Qatar International Islamic Bank	11 149	331	0,0
Uni-President China	943 000	8 578	0,1	Qatar Islamic Bank	263 398	13 842	0,1
Unigroup GX Mi A	37 799	5 241	0,1	Qatar National Bank	686 054	31 392	0,3
Unisplendour A	700	33	0,0			<b>102 057</b>	<b>1,0</b>
Vipshop ADR	105 300	18 767	0,2	RYSSLAND			
Walvax Biotech A	21 800	857	0,0	Alrosa	958 290	0	0,0
Wangfujing A	108 500	3 193	0,0	Mobile TeleSystems Public JO	275 250	0	0,0
Wanhua Chemical A	46 000	6 008	0,1	Norilsk Nickel	8 900	0	0,0
Want Want China Holdings	740 000	5 304	0,1	Polys Gold	5 347	0	0,0
Weibo A	9 600	1 359	0,0	Sberbank	1 200 490	0	0,0
Weichai Power	433 752	6 863	0,1	Sberbank Pref	237 710	0	0,0
Weichai Power A	111 700	2 070	0,0			<b>0</b>	<b>0,0</b>
Wens Foodstuff A	8 820	241	0,0	SAUDIARABIEN			
Will Semiconductor Shanghai A	28 215	4 113	0,0	Advanced Petrochemical	66 102	8 395	0,1
Wingtech Technology A	10 200	742	0,0	Al Mouwasat Medical Services	673	469	0,0
WuXi AppTec	195 050	16 803	0,2	Al Rajhi Bank	289 474	60 855	0,6
Wuxi Aptec A	12 160	1 127	0,0	Alinma Bank	205 393	19 815	0,2
Wuxi Biologics	489 000	25 309	0,3	Almarai	88 642	15 495	0,2
XCMG Construction Machinery A	28 800	290	0,0	Bank Albiad	133 803	14 912	0,2
Xiaomi	1 811 800	26 770	0,3	Banque Saudi Frans	129 146	15 509	0,2
Xinyi Solar Holdings	684 000	8 532	0,1	Bupa Arabia	10 950	5 853	0,1
Yealink Network Technology A	34 790	1 814	0,0	Ethad Etisalat	109 908	15 161	0,2
Yifeng Pharmacy Chain A	11 676	642	0,0	Jarir Marketing	217 620	10 366	0,1
Yihai Kerry Arawana Holdings A	8 300	494	0,0	Riyad Bank	246 602	23 897	0,2
Yunnan Baiyao A	38 480	3 003	0,0	Saudi Awwal Bank	193 011	21 205	0,2
Yunnan Energy New Material A	21 200	3 037	0,0	Saudi Industrial Investment	208 190	15 888	0,2
Zai Lab Unsp ADR	39 000	11 681	0,1				
Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical	20 500	8 729	0,1				
Zhejiang Century Huatong A	24 294	274	0,0				



Handelsbanken Emerging Markets Index, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
Saudi Kayan Petrochemical	46 204	1 839	0,0	Leeno Industrial	13	16	0,0
Savola Group	36 946	4 431	0,0	LG Chemical	6 033	32 986	0,3
Sipchem Br	3 960	420	0,0	LG Chemical Pref	2 545	7 344	0,1
The Saudi National Bank	481 326	51 009	0,5	LG Displays	201 914	26 085	0,3
		<b>285 520</b>	<b>2,9</b>	LG Electronics	19 129	19 868	0,2
<b>SINGAPORE</b>				LG Electronics Pref	2 216	990	0,0
BOC Aviation	500	44	0,0	LG Energy Solution	4 285	19 425	0,2
		<b>44</b>	<b>0,0</b>	LG H&H	2 084	7 841	0,1
<b>SYDAFRIKA</b>				LG Innotek	5 941	15 073	0,2
Absa Group	99 211	9 525	0,1	LG Uplus	21 873	1 924	0,0
Anglo American Platinum	13 459	6 551	0,1	Lotte Chemical	3 537	4 483	0,0
AngloGold Ashanti	87 441	19 887	0,2	Lotte Energy Materials	2 559	1 011	0,0
Aspen Pharmacare	113 480	11 914	0,1	Lotte Shopping	2 289	1 287	0,0
Bid	41 720	9 859	0,1	LS	2 156	1 642	0,0
Bidvest Group	62 669	9 375	0,1	Meritz Finance Holdings	24 679	8 396	0,1
Capitec Bank	14 258	12 781	0,1	Mirae Asset Securities	26 824	1 590	0,0
Clicks Group	75 106	11 221	0,1	Naver	18 718	28 049	0,3
Discovery	62 972	5 251	0,1	NCSOFT	344	832	0,0
FirstRand	439 112	17 198	0,2	Netmarble Games	6 901	2 778	0,0
Gold Fields	115 839	17 329	0,2	NONSHIM	1 374	4 483	0,0
Impala Platinum	120 443	8 630	0,1	Orion	10 104	9 939	0,1
Kumba Iron Ore	28 608	7 239	0,1	Pan Ocean	8 536	362	0,0
MTN Group	216 266	17 083	0,2	Pearlabyss	39 439	17 005	0,2
Naspers	30 531	59 335	0,6	S-1	3 785	1 654	0,0
Nedbank Group	106 082	13 864	0,1	Samsung Biologics	3 034	18 504	0,2
Northam Platinum Holdings	43 528	3 123	0,0	Samsung Card	2 658	646	0,0
Old Mutual	28 428	197	0,0	Samsung Electro-Mechanics	10 971	12 995	0,1
OUTsurance	192 443	3 740	0,0	Samsung Electronics	697 204	412 642	4,2
Pepkor Holdings	30 454	287	0,0	Samsung Electronics Pref	121 154	59 092	0,6
Sanlam	391 882	13 074	0,1	Samsung Fire & Marine Insurance	6 896	13 002	0,1
Sibanye Stillwater	408 297	6 770	0,1	Samsung Life Insurance	18 200	10 041	0,1
Standard Bank Group	170 533	17 312	0,2	Samsung SDI	7 634	41 865	0,4
Vodacom Group	93 585	6 271	0,1	Samsung SDS	3 466	3 492	0,0
Woolworths Holding	351 458	14 338	0,1	Samsung Securities	2 659	785	0,0
		<b>302 152</b>	<b>3,1</b>	Seegene	12 304	2 073	0,0
<b>SYDKOREA</b>				Shinhan Financial Group	71 715	19 988	0,2
Alteogen	45 610	16 058	0,2	Shinsegae	91	133	0,0
AmorePacific	5 041	4 033	0,0	SK Biopharmaceuticals	3 053	2 025	0,0
AmorePacific Group	6 522	1 409	0,0	SK Bioscience	10 052	6 551	0,1
BNK Financial Group	38 107	2 165	0,0	SK Chemicals	5 310	3 056	0,0
Celltrion	12 760	15 993	0,2	SK Telecom	19 751	7 545	0,1
Celltrion HealthCare	18 670	10 024	0,1	Solus Advanced Materials	15 258	4 634	0,0
Celltrion Pharm	756	473	0,0	Soulbrain	152	313	0,0
Chunbo	1 544	2 438	0,0	Ssangyong C&E	25 724	1 116	0,0
CJ	3 292	1 843	0,0	Wonik Ips	74 979	20 160	0,2
CJ CheilJedang	1 472	3 252	0,0	Woori Financial Group	64 259	6 210	0,1
Cosmo AM&T	17 685	27 081	0,3	Woori Investment & Securities	11 236	880	0,0
Coway	7 861	2 832	0,0	Yuhan	9 081	4 496	0,0
CS Wind	40	28	0,0			<b>1 342 891</b>	<b>13,7</b>
Daewoo Engineering & Construction	141 601	4 718	0,0	<b>TAIWAN</b>			
DB Insurance	16 643	10 178	0,1	Accton Technology	139 000	16 824	0,2
DL E&C	13 724	3 909	0,0	Acer	1 120 882	12 187	0,1
Dongsuh Companies	348	54	0,0	Advantech	87 449	12 419	0,1
Doosan Bobcat	4 259	2 049	0,0	ASE Technology Holding	1 273 506	48 804	0,5
Doosan Fuel Cell	101	24	0,0	ASMedia Tech	16 000	5 854	0,1
E-mart	3 955	2 493	0,0	Aspeed Technology	29 000	28 664	0,3
Ecopro	2 745	16 966	0,2	Asustek Computer	173 068	18 877	0,2
Ecopro BM	5 740	11 716	0,1	AU Optronics	1 541 400	9 943	0,1
F&F	10 657	10 448	0,1	Catcher Technology	102 268	6 225	0,1
Fila Korea	443	145	0,0	Cathay Financial Holding	1 372 557	20 540	0,2
Green Cross	57	54	0,0	Chailease Holding	151 248	10 701	0,1
GS Engineering	35 714	5 457	0,1	Chang Hwa Bank	735 874	4 760	0,0
Hana Financial	41 636	13 379	0,1	Cheng Shin Rubber Industry	250 250	3 485	0,0
Hanjin Kai	6 202	2 382	0,0	Chicony Electronics	124 337	4 226	0,0
Hankook Tire	17 252	4 865	0,0	China Airlines	357 000	3 244	0,0
Hanmi Pharmaceutical	1 757	4 443	0,0	China Development Financial Holding	2 124 903	9 138	0,1
Hanmi Science	79	21	0,0	China Steel	2 189 190	22 322	0,2
Hanon Systems	73 974	5 549	0,1	Chinatrust International Holdings	3 115 183	26 848	0,3
Hanssem	8 419	2 985	0,0	Chroma Ate	37 000	3 214	0,0
HL Mando	15 563	6 876	0,1	Chungghwa Telecom	760 672	30 734	0,3
Hugel	2 985	2 692	0,0	Compal Electronics	730 000	7 405	0,1
Hynix Semiconductor	99 604	94 060	1,0	Delta Electronics	506 140	60 472	0,6
Hyundai	17 179	29 080	0,3	E.Sun Financial Holding	2 382 453	21 524	0,2
Hyundai Department Store	8 147	3 292	0,0	Eclat Textile	172 000	29 796	0,3
Hyundai Elevator	1 713	565	0,0	EVA Airways	491 120	6 779	0,1
Hyundai Engineering & Construction	7 022	2 193	0,0	Evergreen Marine	202 820	6 577	0,1
Hyundai Glovis	6 522	10 570	0,1	Far Eastern New Century	225 461	2 616	0,0
Hyundai Marine & Fire Insurance	5 377	1 369	0,0	Far EastTone Telecommunications	294 000	8 014	0,1
Hyundai Merchant Marine	50 251	7 765	0,1	Feng Tay Enterprises	54 972	3 746	0,0
Hyundai Mipo Dockyard	2 302	1 585	0,0	First Financial Holding	1 301 441	12 480	0,1
Hyundai Mobis	8 162	15 556	0,2	Formosa Chemical & Fiber	725 780	16 890	0,2
Hyundai Motor Pref	2 500	2 230	0,0	Formosa Sumco Technology	7 000	407	0,0
Hyundai Pref	4 203	3 780	0,0	Foxconn Technology	100 442	1 937	0,0
Hyundai Steel	9 477	2 622	0,0	Fubon Financial Holding	1 222 984	25 788	0,3
Industrial Bank of Korea	31 845	2 699	0,0	GWC	58 000	9 997	0,1
Kakao	37 873	15 244	0,2	Highwealth Construction	304 836	4 509	0,0
Kakao Games	5 336	1 437	0,0	Hiwin Technologies	77 555	6 388	0,1
Kakao Pay	10 727	4 133	0,0	Hon Hai Precision Industry	1 793 343	70 281	0,7
KakaoBank	60 030	11 687	0,1	Hotai Motor	72 000	20 326	0,2
KB Financial Group	50 733	19 858	0,2	Hua Nan Finance Holding	978 637	7 535	0,1
KCC	1 003	1 615	0,0	Innolux Display	1 524 772	8 064	0,1
Kepco Plant Service & Engineering	16 126	4 409	0,0	Inventec	1 039 000	15 567	0,2
Kia	26 109	18 941	0,2	Largan Precision	18 381	13 578	0,1
Kiwoom	161	117	0,0	Lite-On Technology	558 000	20 029	0,2
Korea Express	1 527	956	0,0	Lotes	26 000	7 755	0,1
Korea Invest Holdings	137	58	0,0	Macronix International	331 000	3 754	0,0
Korea Kumho Petrochemical	1 249	1 359	0,0	Mediatek	237 732	56 725	0,6
Korea Telecom	17 997	4 396	0,0	Mega Financial Holding	1 596 577	21 152	0,2
Korea Zinc	3 052	12 196	0,1	Merida Industry	42 000	3 234	0,0
Korean Air Lines	2 729	545	0,0	Momo.com	12 000	2 863	0,0
Kum Yang	5 142	2 238	0,0	MSI	227 000	13 895	0,1
				Nan Ya	35 000	3 205	0,0

Handelsbanken Emerging Markets Index, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde TSEK	% av fondförm.
Nan Ya Plastics	866 900	21 797	0,2
Nanya Technology	205 800	5 053	0,1
Novatek Microelectronics	38 000	5 621	0,1
Oneness Biotech	72 816	5 455	0,1
Pegatron	286 708	7 438	0,1
Phison Electronics	39 000	5 566	0,1
Pou Chen	304 924	3 331	0,0
Powerchip Semiconductor Manu	222 791	2 391	0,0
Powertech Technology	192 000	6 992	0,1
Quanta Computer	578 638	30 503	0,3
Realtek Semiconductor	98 813	13 279	0,1
Ruentex Development	321 000	4 002	0,0
Shanghai Commercial	610 520	9 613	0,1
Shin Kong Financial Holding	1 101 473	3 400	0,0
Sino-American Silicon Products	89 000	4 985	0,1
SinoPac Financial Holdings	1 644 432	9 895	0,1
Synnex Technology International	441 400	8 879	0,1
Taishin Financial Holding	1 541 303	10 103	0,1
Taiwan Business Bank	314 186	1 553	0,0
Taiwan Cooperative Financial Holding	1 214 480	11 815	0,1
Taiwan Fertilizer	137 000	2 875	0,0
Taiwan High Speed Rail	374 512	4 176	0,0
Taiwan Mobile	229 500	7 609	0,1
Taiwan Semiconductor	3 071 323	613 540	6,3
Tatung	836 000	15 743	0,2
Teco Electric and Machinery	229 000	4 233	0,0
Tripod Technology	431 000	18 460	0,2
Uni-President Enterprises	873 360	23 111	0,2
Unimicron Technology	27 000	1 648	0,0
United Microelectronics	1 912 099	32 162	0,3
Vanguard International	178 000	5 432	0,1
Walsin Tech	93 000	3 077	0,0
Wan Hai Lines	73 265	1 499	0,0
Win Semiconductors	92 000	5 233	0,1
Winbond Electronics	690 000	6 569	0,1
Wistron	1 107 633	34 880	0,4
Wiwynn	12 000	5 910	0,1
WPG Holdings	691 363	13 116	0,1
Yageo	15 962	2 721	0,0
Yang Ming Marine	1 000	22	0,0
Yuanta Financial Holding	2 238 774	17 936	0,2
Yulon Motor	35 145	1 007	0,0
		<b>1 784 923</b>	<b>18,2</b>
<b>THAILAND</b>			
Advanced Info Service f/r	183 983	11 995	0,1
Airports of Thailand f/r	816 980	17 920	0,2
Asset World f/r	666 000	1 002	0,0
Bangkok Commercial f/r	160 800	524	0,0
Bangkok Expressway and Metro	3 349 100	8 724	0,1
Berli Jucker f/r	1 113 900	11 792	0,1
BTS Group Holdings f/r	3 671 000	8 332	0,1
Carabao Group f/r	354 710	7 078	0,1
Central Pattana	552 500	11 025	0,1
Central Retail f/r	914 600	10 867	0,1
Charoen Pokphand Foods	2 224 200	13 349	0,1
Delta Electronics f/r	481 300	13 490	0,1
Energy Absolute	971 400	16 868	0,2
Home Product Center	1 949 537	8 315	0,1
Indorama Ventures	403 600	4 211	0,0
Intouch Holdings f/r	567 600	12 796	0,1
Kasikornbank f/r	73 400	2 896	0,0
KCE Electronics f/r	947 500	11 258	0,1
Krung Thai Bank	3 693 500	21 829	0,2
Krungthai Card f/r	62 300	939	0,0
Land & House f/r	2 829 600	7 284	0,1
Minor International	425 475	4 439	0,0
Muangthai Capital	58 500	700	0,0
Osotspa Public f/r	662 100	6 001	0,1
Scb X Public f/r	146 730	4 761	0,0
SCG Packaging f/r	298 900	3 392	0,0
Siam Cement f/r	140 800	13 812	0,1
Siam Global House f/r	171 410	825	0,0
Srisawad f/r	593 000	8 536	0,1
Thai Union Group	2 869 200	11 276	0,1
Tisco Financial Group f/r	32 600	963	0,0
TMBThanachar f/r	4 647 600	2 195	0,0
TOA Paint (Thailand) f/r	1 021 800	8 483	0,1
True f/r	6 235 446	12 442	0,1
VGI f/r	1 329 700	1 231	0,0
		<b>281 549</b>	<b>2,9</b>
<b>TJECKIEN</b>			
Komercni Banka	20 212	6 662	0,1
		<b>6 662</b>	<b>0,1</b>
<b>TURKIET</b>			
Akbank	54 276	454	0,0
Arcelik	36 841	1 984	0,0
BIM Birlesik Magazalar	87 994	6 216	0,1
Coca-Cola Icecek	19 550	2 129	0,0
Deva Holdings	27 916	565	0,0
Emlak	85 313	262	0,0
Enerjisa Enerji	47 010	682	0,0
Eregil Demir	23 782	362	0,0
Ford Otomotiv Sanayi	10 022	3 160	0,0
Gubre Fabrikalari	3 477	391	0,0
Is Gayrimenkul Yatirim Ortakligi REIT A	1 061 684	4 680	0,0
Isbank	422 347	2 460	0,0
Koza Altin Isletmeleri	664 371	6 826	0,1
Koza Anadolu Metal Madencilik Isletmeleri	11 796	253	0,0
Pegasus Airlines	42 125	10 769	0,1
Petkim Petrochemical Holding	76 109	473	0,0
Sasa Polyester Sanayi	151 517	3 575	0,0

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde TSEK	% av fondförm.
Sisecam	207 739	3 827	0,0
Sok Mark Tic	4 815	66	0,0
Tofas	57 511	6 017	0,1
Turk Traktor	3 569	601	0,0
Turkcell Iletisim Hizmetleri	175 367	2 637	0,0
Turkiye Vakiflar Bankasi	131 678	541	0,0
Türk Hava Yollari	306 249	24 578	0,3
Türk Telekom	63 193	543	0,0
Vestel Elektronik Sanayi ve Ticaret A	65 984	1 558	0,0
Yapi Kredi Bankasi	261 884	1 408	0,0
Ülker	82 634	1 182	0,0
		<b>88 199</b>	<b>0,9</b>
<b>UNGERN</b>			
Gedeon Richter	861	229	0,0
OTP Bank	28 984	11 107	0,1
		<b>11 336</b>	<b>0,1</b>
<b>USA</b>			
BeiGene ADR	9 600	18 488	0,2
		<b>18 488</b>	<b>0,2</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>9 704 000</b>	<b>99,2</b>

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 0,0**

	Underliggande exponering TSEK	Marknadsvärde TSEK	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
MSCI Emerging Mkts Sep 2023	86 229	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>

**Övriga finansiella instrument 0,0**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde TSEK	% av fondförm.
<b>ONOTERADE AKTIER</b>			
<b>BRASILIEN</b>			
Zurich Santander Brasil Seguros e Previdenc	101 218	0	0,0
		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>HONGKONG</b>			
China Common Rich Renewable Energy Inv	882 000	0	0,0
		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>KINA</b>			
China Huishan Dairy Holdings	421 100	0	0,0
		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>NEDERLÄNDERNA</b>			
Yandex	36 878	4	0,0
		<b>4</b>	<b>0,0</b>
<b>TAIWAN</b>			
Acer R	448	3	0,0
Yulon Motor R	1 968	10	0,0
		<b>13</b>	<b>0,0</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>17</b>	<b>0,0</b>
	<b>Antal/Nom. bel. tusental</b>	<b>Marknadsvärde TSEK</b>	<b>% av fondförm.</b>
<b>OTC-DERIVATINSTRUMENT</b>			
<b>VALUTATERMINER</b>			
HKD/SEK <sup>1)</sup>		5	0,0
		<b>5</b>	<b>0,0</b>
<b>OTC-derivatinstrument</b>		<b>5</b>	<b>0,0</b>

<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>	<b>9 704 023</b>	<b>99,2</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>	<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Netto, övriga tillgångar och skulder</b>	<b>83 130</b>	<b>0,8</b>
<b>Total summa fondförmögenhet</b>	<b>9 787 153</b>	<b>100,0</b>

<sup>1)</sup> HKD 4 000/ISEK -5 508, motpart Svenska Handelsbanken

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

### Sammanställning, företags- och koncernexponeringar \*

Företag/koncern	% av fondförmögenheten	Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Samsung	5,5	WuXi AppTec	0,2
LG	0,9	Agricultural Bank Of China	0,2
Hyundai Group	0,7	China Pacific Insurance Group	0,1
Ping An	0,6	Acer	0,1
Tata	0,5	China Railway	0,1
BYD	0,5	Bank of Communications	0,1
Banco Bradesco	0,5	China Molybdenum	0,1
China Merchants Bank	0,4	China Securities	0,1
ZTE Corporation	0,4	CITIC Securities	0,1
China Life Insurance	0,3		

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehåller mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

Handelsbanken Emerging Markets Index, forts.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

<b>Volym utlånade värdepapper, tSEK</b>	<b>420 390</b>
---	----------------

<b>Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar</b>	<b>4,3</b>
--	------------

**De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:**

Amerikanska staten	164 884
Brittiska staten	65 225
Franska staten	36 387
Österrikiska staten	6 727
Tyska staten	5 073
Nvidia	4 729
Starbucks	3 744
Genuine Parts	3 480
Deere & Co	3 425
Keysight Technologies	3 330

**De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:**

Barclays Bank	95 505
UBS AG London Branch	84 717
Morgan Stanley & Co. International	56 278
J.P. Morgan Securities	55 730
Merrill Lynch International	49 079
Goldman Sachs International	43 622
HSBC Bank	34 522
Barclays Capital Securities	22 989
BNP Paribas Arbitrage SNC	9 777
Citigroup Global Markets	7 112

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:**

Aktier	180 087
Obligationer och andra räntebärande instrument	282 494

**462 581**

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	1 468
En till tre månader	988
Tre månader till ett år	13 875
Mer än ett år	266 163
Obestämmd löptid	180 087

**462 581****Motparternas hemvist, tSEK**

Frankrike	9 777
Storbritannien	449 554
Sverige	3 250

**462 581****Säkerheternas valuta, tSEK**

AUD	925
CHF	95
DKK	2 758
EUR	56 917
GBP	84 898
HKD	400
JPY	25 791
NZD	1
SEK	2 338
SGD	17
USD	288 439

**462 581****Avveckling och clearing, tSEK**

Tredje part	462 581
-------------	---------

**462 581**

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämmd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 4 133 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- Barclays Bank
- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- Credit Suisse International
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- SEB
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende sponsrad, garanterad, godkänd, emitterad, marknadsförd, såld eller understödd på något annat sätt av Solactive AG (Solactive) och Solactive lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av dess index, index varumärke eller indexnivå kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. Indexet beräknas och publiceras av Solactive. Solactive gör sitt bästa för att se till att indexet beräknas korrekt. Oavssett skyldigheter gentemot fondens emittent har Solactive ingen skyldighet att påpeka fel i indexet till tredje part, inklusive men inte begränsat till investerare i fonden och/eller finansiella intermedärer i fonden. Varken offentliggörande av index eller licensiering av index eller index varumärke för användning i samband med fonden utgör någon rekommendation från Solactive att investera kapital i fonden, ej heller utgör det inte på något sätt en försäkran eller åsikt från Solactive avseende eventuella investeringar i denna fond.



# Handelsbanken Europa Index Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Europe Index så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,2%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagsändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Index är återinvesterande, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet, justerat för skatt. Indexet speglar bolag på de utvecklade aktiemarknaderna i Europa exklusive de bolag som ej uppfyller indexets hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven i indexet syftar till en minskning av koldioxidutsläppen och bolagen i index väljs ut och viktas på så sätt att indexportföljens utsläpp av växthusgaser anpassas till de långsiktiga globala uppvärmningsmålen i Parisavtalet. Hållbarhetskraven i index innebär vidare att bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer, bolag som avsevärt skadar miljömässiga mål samt bolag som är verksamma inom kontroversiella sektorer inte ingår i index. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 19,4% under första halvåret 2023\*.

De tre största aktieinnehaven i fonden var vid halvårsskiftet Nestlé, ASML och Novo Nordisk. De största sektorerna var hälsovård, finans och verkstadsbolag. Fonden följer ett index som är i linje med Parisavtalets klimatmål så kallat EU Paris Aligned Benchmarks. Denna utveckling är ett viktigt steg på vägen att nå fondbolagets mål om nettonollutsläpp i våra portföljer till år 2040 samt att linjera allt vårt förvaltade kapital i enlighet med Parisavtalets målsättningar.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till den europeiska aktiemarknaden. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker i företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Då fondens investeringar sker i utländska aktier denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. Då fonden består av olika andelsklasser kan förändringar i valutakurser medföra att värdet och riskklassificeringen skiljer sig åt mellan olika andelsklasser beroende på vilken valuta andelsklassen handlas i. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 1,9%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0,1%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0,8%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är upp för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är upp för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

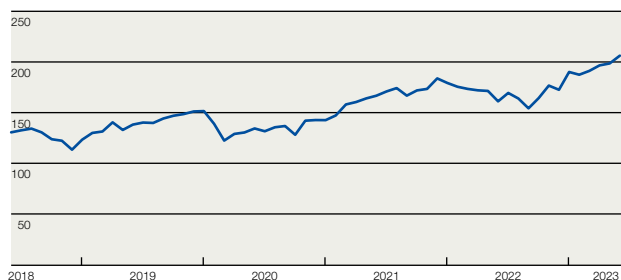
Handelsbanken Europa Index Criteria, forts.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas

informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
<b>Andelsvärde, SEK</b>										
Europa Index Criteria A1 - SEK	186,58	156,22	166,33	129,26	136,92	102,89	112,90	100,68	94,14	90,19
Europa Index Criteria A1 - EUR	15,83	14,05	16,15	12,86	13,03	10,15	11,48	10,51	10,28	-
Europa Index Criteria A1 - NOK	185,06	147,70	162,00	134,76	128,53	100,49	112,79	95,40	98,84	-
Europa Index Criteria A9 - SEK	187,56	156,97	166,96	129,63	137,17	102,98	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - EUR	15,92	14,12	16,22	12,90	13,05	10,16	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - NOK	186,04	148,41	162,62	135,14	128,76	100,57	-	-	-	-
Europa Index Criteria B1 - SEK	128,03	111,00	122,45	98,59	109,15	83,83	95,41	88,08	85,47	84,56
Europa Index Criteria B1 - EUR	10,86	9,98	11,89	9,80	10,39	8,27	-	-	-	-
Fondens totala nettolöde, mnSEK	-755	-2 788	2 368	7 211	-1 103	915	579	-195	1 040	1 015
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	22 627	19 605	24 218	16 774	9 745	8 300	8 274	6 846	6 629	5 460
Europa Index Criteria A1 - SEK	17 178	14 071	14 891	11 064	8 150	6 620	7 461	6 281	5 808	5 384
Europa Index Criteria A1 - EUR	179	156	189	144	76	58	43	35	40	-
Europa Index Criteria A1 - NOK	737	566	775	454	196	185	173	121	343	-
Europa Index Criteria A9 - SEK	1 592	2 058	4 788	3 064	20	554	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - EUR	33	46	64	41	16	4	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - NOK	449	498	772	116	220	87	-	-	-	-
Europa Index Criteria B1 - SEK	152	104	341	227	154	150	214	105	125	76
Europa Index Criteria B1 - EUR	1	1	0	0	1	1	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	121 599	125 694	146 201	130 245	71 474	81 158	73 629	68 146	70 546	60 588
Europa Index Criteria A1 - SEK	92 070	90 073	89 526	85 593	59 524	64 339	66 084	62 379	61 690	59 693
Europa Index Criteria A1 - EUR	11 284	11 082	11 701	11 228	5 867	5 667	3 772	3 305	3 918	-
Europa Index Criteria A1 - NOK	3 981	3 835	4 786	3 371	1 522	1 845	1 535	1 266	3 473	-
Europa Index Criteria A9 - SEK	8 486	13 109	28 678	23 639	145	5 381	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - EUR	2 104	3 235	3 953	3 206	1 200	408	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - NOK	2 416	3 354	4 750	858	1 712	863	-	-	-	-
Europa Index Criteria B1 - SEK	1 188	934	2 784	2 298	1 409	1 795	2 238	1 196	1 465	895
Europa Index Criteria B1 - EUR	71	71	23	51	54	66	-	-	-	-
<b>Total avkastning i %</b>										
Europa Index Criteria A1 - SEK	19,4	-6,1	28,7	-5,6	33,1	-8,9	12,1	6,9	4,4	14,0
Europa Index Criteria A1 - EUR	12,7	-13,0	25,6	-1,3	28,3	-11,6	9,3	2,2	8,0	6,5
Europa Index Criteria A1 - NOK	25,3	-8,8	20,2	4,9	27,9	-10,9	18,2	-3,5	14,4	15,6
Europa Index Criteria A9 - SEK	19,5	-6,0	28,8	-5,5	33,2	-8,8	12,4	7,3	4,7	14,3
Europa Index Criteria A9 - EUR	12,8	-13,0	25,7	-1,2	28,5	-11,5	9,5	2,5	8,3	6,8
Europa Index Criteria A9 - NOK	25,4	-8,7	20,3	5,0	28,0	-10,8	18,5	-3,2	14,8	15,9
Europa Index Criteria B1 - SEK	19,4	-6,1	28,6	-5,4	33,1	-8,9	12,1	6,9	4,4	14,0
Europa Index Criteria B1 - EUR	12,7	-13,0	25,5	-1,1	28,4	-11,6	9,3	2,2	8,0	6,5
<b>Jämförelseindex inklusive utdelning i %</b>										
Europa Index Criteria A1 - SEK	19,3	-6,1	28,6	-5,4	33,0	-8,9	12,2	7,3	4,6	14,4
Europa Index Criteria A1 - EUR	12,6	-13,0	25,5	-1,1	28,3	-11,6	9,4	2,6	8,2	6,8
Europa Index Criteria A1 - NOK	25,2	-8,8	20,2	5,1	27,8	-10,9	18,3	-3,1	14,7	15,9
Europa Index Criteria A9 - SEK	19,3	-6,1	28,6	-5,4	33,0	-8,9	12,2	7,3	4,6	14,4
Europa Index Criteria A9 - EUR	12,6	-13,0	25,5	-1,1	28,3	-11,6	9,4	2,6	8,2	6,8
Europa Index Criteria A9 - NOK	25,2	-8,8	20,2	5,1	27,8	-10,9	18,3	-3,1	14,7	15,9
Europa Index Criteria B1 - SEK	19,3	-6,1	28,6	-5,4	33,0	-8,9	12,2	7,3	4,6	14,4
Europa Index Criteria B1 - EUR	12,6	-13,0	25,5	-1,1	28,3	-11,6	9,4	2,6	8,2	6,8
<b>Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)</b>										
Europa Index Criteria A1 - SEK	0,1	0,1	0,2	0,2	0,2	0,1	0,1	0,2	0,1	0,1
Europa Index Criteria A1 - EUR	0,1	0,1	0,2	0,2	0,2	0,1	0,1	0,2	0,1	-
Europa Index Criteria A1 - NOK	0,1	0,1	0,2	0,2	0,2	0,1	0,1	0,2	0,1	-
Europa Index Criteria A9 - SEK	0,1	0,1	0,2	0,2	0,2	0,1	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - EUR	0,1	0,1	0,2	0,2	0,2	0,1	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - NOK	0,1	0,1	0,2	0,2	0,2	0,1	-	-	-	-
Europa Index Criteria B1 - SEK	0,1	0,1	0,2	0,2	0,2	0,1	0,1	0,2	0,1	0,1
Europa Index Criteria B1 - EUR	0,1	0,1	0,2	0,2	0,2	0,1	-	-	-	-
<b>Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %</b>										
Europa Index Criteria A1 - SEK	11,2	9,9	10,2	12,1	10,1	1,1	9,5	5,7	9,1	18,5
Europa Index Criteria A1 - EUR	3,1	4,5	11,3	12,6	6,5	-1,7	5,7	5,0	7,2	-
Europa Index Criteria A1 - NOK	10,4	4,7	12,3	15,8	6,7	2,6	6,8	5,1	15,0	-
Europa Index Criteria A9 - SEK	11,3	10,0	10,3	12,2	10,2	1,3	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - EUR	3,2	4,6	11,5	12,7	6,6	-1,5	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - NOK	10,5	4,8	12,4	15,9	6,9	2,8	-	-	-	-
Europa Index Criteria B1 - SEK	11,2	9,9	10,3	12,2	10,1	1,1	9,5	5,7	9,1	18,5
Europa Index Criteria B1 - EUR	3,1	4,5	11,4	12,7	6,5	-1,7	-	-	-	-
<b>Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %</b>										
SEK	11,2	9,9	10,3	12,2	10,1	1,1	9,7	6,0	9,4	18,9
EUR	3,1	4,5	11,4	12,6	6,5	-1,7	5,9	5,4	7,5	-
NOK	10,4	4,7	12,4	15,9	6,7	2,7	7,1	5,4	15,3	-
<b>Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %</b>										
Europa Index Criteria A1 - SEK	9,5	6,7	10,6	6,5	8,7	5,4	11,9	12,1	8,4	6,9
Europa Index Criteria A1 - EUR	6,9	4,1	9,0	4,6	6,5	2,6	8,9	10,4	8,1	-
Europa Index Criteria A1 - NOK	11,4	5,5	11,2	6,4	8,3	6,1	15,5	14,0	12,7	-

Handelsbanken Europa Index Criteria, forts.

Europa Index Criteria A9 - SEK	9,6	6,8	10,7	6,7	8,9	5,6	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - EUR	7,0	4,2	9,1	4,8	6,7	2,8	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - NOK	11,5	5,6	11,3	6,6	8,5	6,4	-	-	-	-
Europa Index Criteria B1 - SEK	9,6	6,7	10,6	6,6	8,7	5,4	11,9	-	-	-
Europa Index Criteria B1 - EUR	7,0	4,1	9,0	4,6	6,5	2,6	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	9,6	6,7	10,6	6,7	8,8	5,6	12,2	12,4	8,7	7,2
EUR	6,9	4,1	9,0	4,7	6,6	2,8	9,2	10,8	8,4	-
NOK	11,4	5,6	11,2	6,5	8,4	6,3	15,8	14,3	13,0	-
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %										
Europa Index Criteria A1 - SEK	10,6	9,3	11,3	7,5	7,8	6,9	3,4	3,1	3,7	6,0
Europa Index Criteria A1 - EUR	7,4	6,5	9,7	6,3	7,5	7,8	3,0	2,5	3,9	-
Europa Index Criteria A1 - NOK	11,6	10,4	12,6	9,5	9,4	7,9	5,2	3,5	5,9	-
Europa Index Criteria A9 - SEK	10,8	9,5	11,6	7,7	8,1	7,2	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - EUR	7,6	6,7	9,9	6,6	7,8	8,1	-	-	-	-
Europa Index Criteria A9 - NOK	11,8	10,6	12,8	9,7	9,7	8,3	-	-	-	-
Europa Index Criteria B1 - SEK	10,6	9,3	-	-	-	-	-	-	-	-
Europa Index Criteria B1 - EUR	7,4	6,5	9,7	6,3	7,5	7,8	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	10,8	9,5	11,5	7,7	8,0	7,2	3,6	3,3	3,9	6,3
EUR	7,5	6,6	9,9	6,5	7,8	8,0	3,2	2,7	4,2	-
NOK	11,8	10,6	12,8	9,7	9,7	8,2	5,5	3,8	6,2	-
Utdelning per andel, SEK										
Europa Index Criteria B1 - SEK	4,07	3,92	3,69	4,37	2,10	3,34	3,08	2,99	2,96	2,69
Europa Index Criteria B1 - EUR	0,36	0,37	0,36	0,42	0,20	0,33	-	-	-	-
Omräkningskurs EUR/SEK	11,78	11,12	10,30	10,05	10,51	10,13	9,83	9,58	9,16	-
Omräkningskurs NOK/SEK	1,01	1,06	1,03	0,96	1,07	1,02	1,00	1,06	0,95	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta - historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Europe Index

T o m 2017-05-31: MSCI Europa Net Index

T o m 2019-03-31: MSCI Europe Select Global Norms Ex Controversial Business

T o m 2021-05-20: Solactive ISS ESG Screened Europe

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se Information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Europa Index Criteria A1	0,20
Europa Index Criteria A9	0,10
Europa Index Criteria B1	0,20
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Europa Index Criteria A1	0,20
Europa Index Criteria A9	0,10
Europa Index Criteria B1	0,20
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Europa Index Criteria A1	0,20
Europa Index Criteria A9	0,10
Europa Index Criteria B1	0,20
Transaktionskostnader, tSEK	12 471
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,06

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,4
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	0,0
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk % - A1 SEK	14,4	Aktiv avkastning % - B1 EUR	0,0
Total risk % - A1 EUR	16,1	Informationskvot - A1 SEK	0,2
Total risk % - A1 NOK	14,1	Informationskvot - A1 EUR	0,2
Total risk % - A9 SEK	14,4	Informationskvot - A1 NOK	0,2
Total risk % - A9 EUR	16,1	Informationskvot - A9 SEK	1,1
Total risk % - A9 NOK	14,1	Informationskvot - A9 EUR	1,0
Total risk % - B1 SEK	14,4	Informationskvot - A9 NOK	1,1
Total risk % - B1 EUR	16,1	Informationskvot - B1 SEK	0,2
Total risk i index % - A1 SEK	14,4	Informationskvot - B1 EUR	0,2
Total risk i index % - A1 EUR	16,1	Sharpekvot - A1 SEK	0,7
Total risk i index % - A1 NOK	14,1	Sharpekvot - A1 EUR	0,1
Total risk i index % - A9 SEK	14,4	Sharpekvot - A1 NOK	0,6
Total risk i index % - A9 EUR	16,1	Sharpekvot - A9 SEK	0,7
Total risk i index % - A9 NOK	14,1	Sharpekvot - A9 EUR	0,2
Total risk i index % - B1 SEK	14,4	Sharpekvot - A9 NOK	0,7
Total risk i index % - B1 EUR	16,1	Sharpekvot - B1 SEK	0,7
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG	Sharpekvot - B1 EUR	0,1
	Screened Paris Aligned	Sharpekvot i index - A1 SEK	0,7
	Europe Index	Sharpekvot i index - A1 EUR	0,1
Aktiv avkastning % - A1 SEK	0,0	Sharpekvot i index - A1 NOK	0,6
Aktiv avkastning % - A1 EUR	0,0	Sharpekvot i index - A9 SEK	0,7
Aktiv avkastning % - A1 NOK	0,0	Sharpekvot i index - A9 EUR	0,1
Aktiv avkastning % - A9 SEK	0,1	Sharpekvot i index - A9 NOK	0,6
Aktiv avkastning % - A9 EUR	0,1	Sharpekvot i index - B1 SEK	0,7
Aktiv avkastning % - A9 NOK	0,1	Sharpekvot i index - B1 EUR	0,1
Aktiv avkastning % - B1 SEK	0,0		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	22 534 121	99,6	19 496 777	99,4
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> (Not 1)	<b>22 534 121</b>	<b>99,6</b>	<b>19 496 777</b>	<b>99,4</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	-79 117	-0,3	80 411	0,4
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	26 688	0,1	29 105	0,1
Övriga tillgångar	153 311	0,7	53 617	0,3
<b>Summa tillgångar</b>	<b>22 635 002</b>	<b>100,0</b>	<b>19 659 909</b>	<b>100,3</b>
<b>SKULDER</b>				
OTC-derivatinstrument med negativt marknadsvärde	257	0,0	-	-
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>	<b>257</b>	<b>0,0</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	3 579	0,0	3 236	0,0
Övriga skulder	4 568	0,0	51 578	0,3
<b>Summa skulder</b>	<b>8 404</b>	<b>0,0</b>	<b>54 814</b>	<b>0,3</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>22 626 597</b>	<b>100,0</b>	<b>19 605 095</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	1 033 051	4,6	1 761 606	9,0
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	1 146 924	5,1	1 904 955	9,7
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	7 325	0,0	11 972	0,1

1) Likvida medel 7 325 tSEK

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 99,6**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>BELGIEN</b>			
Ackermans	5 122	9 102	0,0
Ageas	12 496	5 465	0,0
Azelis Group	172 398	42 419	0,2
D'ieteren Group	28 233	53 865	0,2
Elia Group	9 102	12 474	0,1
GBL	25 382	21 584	0,1
KBC	36 054	27 158	0,1
Proximus	32 329	2 600	0,0
Sofina	3 618	8 088	0,0
Solvay	22 297	26 880	0,1
UCB	56 649	54 206	0,2
Unicore	50 387	15 195	0,1
Warehouses de Pauw REIT	20 110	5 953	0,0
		<b>284 987</b>	<b>1,3</b>



Handelsbanken Europa Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusenatal	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusenatal	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>SPANIEN</b>							
Aena	14 146	24 672	0,1	Castellum	76 284	7 853	0,0
Amadeus IT Holdings	93 158	76 516	0,3	Electrolux	26 599	3 915	0,0
Banco Santander	3 888 645	155 116	0,7	Elekta B	313 757	26 149	0,1
BBVA	1 692 396	140 243	0,6	Embracer Group B	227 517	6 134	0,0
CaixaBank	842 122	37 581	0,2	Epiroc A	162 780	33 191	0,1
Cellnex Telecom	79 662	34 725	0,2	Epiroc B	96 010	16 735	0,1
Corp ACCIONA Energias Renovables	23 778	8 580	0,0	EQT	7 833	1 625	0,0
EDP Renovaveis	77 780	16 769	0,1	Ericsson B	1 289 410	75 314	0,3
Endesa	40 213	9 312	0,0	Essity B	151 761	43 571	0,2
Grifols	177	24	0,0	Fabege	78 671	6 102	0,0
Grifols Pref B	79 070	7 743	0,0	Fastighets AB Balder	317 291	12 489	0,1
Iberdrola	1 378 378	194 105	0,9	Getinge B	31 759	6 001	0,0
Inditex	315 602	131 880	0,6	Handelsbanken A	353 806	31 963	0,1
Mapfre	292 080	6 261	0,0	Handelsbanken B	32 340	3 480	0,0
Red Electrica	164 291	29 786	0,1	Hennes & Mauritz B	110 622	20 485	0,1
Telefónica	1 765 731	77 322	0,3	Hexagon B	376 816	50 022	0,2
		<b>950 635</b>	<b>4,2</b>	Holmen B1	115 834	44 874	0,2
				Husqvarna B	176 896	17 272	0,1
<b>STORBRITANNIEN</b>							
3i	244 974	65 548	0,3	Industrivärden A	38 017	11 359	0,1
Abrdn	764 170	22 897	0,1	Industrivärden C	36 059	10 717	0,0
Admiral Group	3 519	1 006	0,0	Indutrade	8 272	2 009	0,0
Allfunds Group	1 324	87	0,0	Investor A	81	17	0,0
Antofagasta	274 271	55 026	0,2	Investor B	165 867	35 769	0,2
Ashtead Group	28 776	21 512	0,1	Kinnevik B	157 479	23 527	0,1
AstraZeneca	383 574	593 944	2,6	L E Lundbergföretagen B	22	10	0,0
Auto Trader Group	168 247	14 103	0,1	Lifco B	3 481	816	0,0
Aviva	620 796	33 690	0,1	Millicom International Cellular SDB	49 783	8 207	0,0
Barclay	3 189 691	67 183	0,3	NIBE Industrier B	210 118	21 516	0,1
Barratt Developments	728 441	41 363	0,2	Sagax B	123 714	26 351	0,1
Berkeley Group Holdings	19 605	10 562	0,0	Sandvik	326 988	68 733	0,3
British Land	1 211 284	50 367	0,2	SCA B	34 309	4 716	0,0
BT Group	723 376	12 154	0,1	SEB A	643 903	76 721	0,3
Bunzl	164 360	67 688	0,3	Securitas	24 144	2 136	0,0
Burberry	201 395	58 631	0,3	Skanska B	299 448	45 262	0,2
CNH Industrial	691 369	107 584	0,5	SKF B	236 082	44 289	0,2
Coca-Cola European Partners	25 213	17 552	0,1	SSAB A	56 601	4 337	0,0
ConvaTec Group	109 826	3 095	0,0	SSAB B	134 030	10 012	0,0
CPG	308 510	93 288	0,4	Sweco B	145 317	17 249	0,1
Croda International	53 547	41 369	0,2	Swedbank A	338 314	61 522	0,3
DS Smith	86 003	3 210	0,0	Swedish Orphan Biovitrum	69 245	14 569	0,1
GSK	1 184 236	225 849	1,0	Tele2 B	109 786	9 784	0,0
Haleon	1 637 250	72 452	0,3	Telia	601 661	14 229	0,1
Halma	219 469	68 624	0,3	Thule Group	29 527	9 363	0,0
Hikma Pharmaceuticals	79 985	20 765	0,1	Trelleborg B	132 356	34 598	0,2
HSBC	4 465 437	381 229	1,7	Vitrolife	91 543	19 169	0,1
Informa	164 392	16 389	0,1	Volvo A	42 304	9 713	0,0
Intercontinental Hotels Group	28 624	21 360	0,1	Volvo B	223 860	49 921	0,2
Intermediate Capital Group	3 121	590	0,0	Wallenstam B	81 134	2 963	0,0
International Airlines Group	817 593	18 177	0,1			<b>1 408 468</b>	<b>6,2</b>
Intertek Group	3 225	1 889	0,0	<b>TYSKLAND</b>			
JD Sports Fashion	549 293	11 013	0,0	Adidas	40 558	84 969	0,4
Johnson Matthey	75 259	18 044	0,1	Allianz	103 386	259 747	1,1
Kingfisher	4 535	144	0,0	Bayer	246 770	147 348	0,7
Land Securities Group REIT	732 412	57 751	0,3	Beiersdorf	49 647	70 937	0,3
Legal & General Group	1 368 708	42 722	0,2	BioNTech SE ADR	55 224	64 426	0,3
Liberty Global A	49 510	9 016	0,0	BMW	122 413	162 315	0,7
Liberty Global C	75 060	14 407	0,1	BMW Pref	14 126	17 346	0,1
Lloyds Banking Group	14 945 402	89 461	0,4	Carl-Zeiss Meditec	1 178	1 375	0,0
London Stock Exchange	86 735	99 645	0,4	Daimler Truck Holding	124 597	48 453	0,2
Mondi	43 787	7 210	0,0	Delivery Hero	88 849	42 305	0,2
Natwest Group	1 626 456	53 782	0,2	Deutsche Annington Immobilien	26 150	5 514	0,0
Next	40 318	38 202	0,2	Deutsche Bank	449 180	50 910	0,2
Ocado Group	114 036	8 895	0,0	Deutsche Boerse N	42 118	83 929	0,4
Pearson	233 444	26 351	0,1	Deutsche Telekom N	768 704	180 954	0,8
Persimmon	141 483	19 924	0,1	DHL Group	310 407	163 618	0,7
Phoenix Group Holdings	208 452	15 223	0,1	Dr Ing hc F Porsche Pref	39 508	52 959	0,2
Prudential	898 048	136 702	0,6	Evonik Industries	37 588	7 721	0,0
Reckitt Benckister Group	203 782	165 440	0,7	Fresenius	110 662	33 084	0,1
RELX	262 330	94 418	0,4	Hannover Rueck N	13 545	31 022	0,1
Rentokil Initial	552 995	46 702	0,2	Hapag-Lloyd N	491	1 076	0,0
Rightmove	207 692	14 922	0,1	Heidelberg Materials	1 667	1 477	0,0
Rio Tinto GBP	133 579	91 451	0,4	Henkel	45 322	34 448	0,2
Sage Group	137 863	17 508	0,1	Henkel Pref	66 989	57 832	0,3
Schroders	422 598	25 377	0,1	Inineon Technologies	281 361	125 281	0,6
Segro	11 261	1 108	0,0	Knorr Bremse	39 691	32 732	0,1
Severn Trent	169 553	59 745	0,3	Mercedes-Benz Group N	251 296	218 161	1,0
Smith & Nephew	538 414	93 751	0,4	Merck KGaA	43 604	77 872	0,3
Spirax-Sarco Engineering	16 383	23 319	0,1	Münchener Rück	27 438	111 098	0,5
St. James's Place	113 116	16 893	0,1	Porsche Automobil Holding Pref	64 881	42 174	0,2
Standard Chartered HKD	753 225	70 646	0,3	Puma	36 431	23 664	0,1
Taylor Wimpey	782 164	11 036	0,0	SAP	232 319	342 596	1,5
Unilever	713 644	401 552	1,8	Sartorius Pref	1 906	7 122	0,0
United Utilities Group	443 648	58 583	0,3	Siemens Healthineers	38 281	23 395	0,1
Vodafone Group	5 457 914	55 440	0,2	Siemens N	221 577	398 299	1,8
Weir Group	305 357	73 633	0,3	Talanx	41 676	25 808	0,1
Whitbread	83 396	38 777	0,2	Telefónica Germany	170 805	5 187	0,0
Wise A	231 877	20 926	0,1	Volkswagen	5 991	10 795	0,0
WPP	131 498	14 869	0,1	Volkswagen Pref	54 820	79 421	0,4
		<b>4 253 775</b>	<b>18,8</b>	Zalando	61 634	19 145	0,1
						<b>3 146 513</b>	<b>13,9</b>
<b>SVERIGE</b>							
AarhusKarlskamm	46 018	9 332	0,0	<b>ÖSTERRIKE</b>			
Addtech B	51 941	12 196	0,1	ams OSRAM	137 155	10 667	0,0
Alfa Laval	94 118	36 988	0,2	Andritz	19 924	11 986	0,1
Assa Abloy B	207 396	53 716	0,2	Bawag Group	37 094	18 455	0,1
Atlas Copco A	774 169	120 306	0,5	CA Immobilien	14 240	4 455	0,0
Atlas Copco B	359 301	48 236	0,2	Erste Group Bank	49 328	18 654	0,1
Avanza Bank Holding	35 185	7 723	0,0	Mayr Melnhof	2 852	4 510	0,0
Axfood	108 273	24 708	0,1	Raiffeisen Bank International	29 612	5 067	0,0
Beijer Ref B	27 835	3 830	0,0	Verbund	36 342	31 456	0,1
Boliden	143 394	44 674	0,2	Vienna Insurance Group	28 999	8 184	0,0
				Voestalpine	18 804	7 290	0,0



Handelsbanken Europa Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
Wienerberger	63	21	0,0
		120 746	0,5
<b>Noterade aktier</b>		22 534 121	99,6

#### Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 0,0

	Underliggande exponering tSEK	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
STOXX EURO ESG-X Sep 2023	88 223	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		0	0,0

#### Övriga finansiella instrument 0,0

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>ONOTERADE AKTIER</b>			
<b>STORBRIANNIEN</b>			
NMC Health	17 523	0	0,0
		0	0,0
<b>Onoterade aktier</b>		0	0,0

#### OTC-DERIVATINSTRUMENT

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>VALUTATERMINER</b>			
SEK/CHF <sup>1)</sup>		-114	0,0
SEK/DKK <sup>2)</sup>		-7	0,0
SEK/EUR <sup>3)</sup>		-60	0,0
SEK/GBP <sup>4)</sup>		-68	0,0
SEK/NOK <sup>5)</sup>		-7	0,0
		-257	0,0
<b>OTC-derivatinstrument</b>		-257	0,0

<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		22 534 121	99,6
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		-257	0,0
Netto, övriga tillgångar och skulder		92 734	0,4
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		22 626 597	100,0

1) tSEK 33 691/tCHF -2 800, motpart Svenska Handelsbanken  
 2) tSEK 11 071/tDKK -7 000, motpart Svenska Handelsbanken  
 3) tSEK 70 645/tEUR -6 000, motpart Svenska Handelsbanken  
 4) tSEK 27 396/tGBP -2 000, motpart Nordea Bank  
 5) tSEK 6 042/tNOK -6 000, motpart Svenska Handelsbanken

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

#### Sammanställning, företags- och koncernexponeringar \*

Företag/koncern	% av fondförmögenheten	Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Roche Holding	2,8	Volvo	0,3
BMW	0,8	Schindler Holding	0,3
Atlas Copco	0,7	Epiroc	0,2
Henkel	0,4	Investor	0,2
Volkswagen AG	0,4	Svenska Handelsbanken	0,2
Swatch Group	0,3	Liberty Global	0,1

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehar mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

#### Uppgifter om fondens värdepapperslån

<b>Volym utlånade värdepapper, tSEK</b>	1 033 051
<b>Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar</b>	4,6

#### De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:

Amerikanska staten	521 510
Franska staten	74 741
Brittiska staten	15 143
Tyska staten	15 044
Hsbc Holdings	12 747
Shell	11 599
Rio Tinto	11 433
AstraZeneca	11 106
BP	10 333
Belgiska staten	10 198

#### De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:

BNP Paribas Arbitrage SNC	267 417
Goldman Sachs International	239 598
SEB	143 848
Svenska Handelsbanken	113 955
Barclays Capital Securities	100 207
Morgan Stanley & Co. International	81 866
UBS AG London Branch	63 606
J.P. Morgan Securities	56 060
Citigroup Global Markets	45 847
Barclays Bank	22 100

#### Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:

Obligationer och andra räntebärande instrument	643 607
Aktier	503 316
	1 146 924

Vi godtar statsobligationer och statskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

#### Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	191
En till tre månader	128
Tre månader till ett år	10 333
Mer än ett år	632 956
Obestämd löptid	503 316
	1 146 924

#### Motparternas hemvist, tSEK

Frankrike	267 417
Storbritannien	621 704
Sverige	257 803
	1 146 924

#### Säkerheternas valuta, tSEK

AUD	950
CHF	10 883
DKK	3 664
EUR	132 317
GBP	143 541
HKD	27 792
JPY	149 325
NZD	476
SEK	8 826
SGD	1 697
USD	667 453
	1 146 924

#### Avveckling och clearing, tSEK

Tredje part	1 146 924
	1 146 924

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

#### Uppgifter om avkastning och kostnad:

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 1 335 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. I dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

#### Motparter för värdepappersutlåning under året:

- Barclays Bank
- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- Credit Suisse International
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- SEB
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende sponsrad, garanterad, godkänd, emitterad, marknadsförd, såld eller understödd på något annat sätt av Solactive AG (Solactive) och Solactive lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av dess index, index varumärke eller indexnivå kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. Indexet beräknas och publiceras av Solactive. Solactive gör sitt bästa för att se till att indexet beräknas korrekt. Oavsett skyldigheter gentemot fondens emittent har Solactive ingen skyldighet att påpeka fel i indexet till tredje part, inklusive men inte begränsat till investerare i fonden och/eller finansiella intermediärer i fonden. Varken offentliggörande av index eller licensiering av index eller index varumärke för användning i samband med fonden utgör någon rekommendation från Solactive att investera kapital i fonden, ej heller utgör det inte på något sätt en försäkring eller åsikt från Solactive avseende eventuella investeringar i denna fond.



# Handelsbanken Global Dynamisk Strategi

## Placeringsinriktning

Fonden är en regelstyrd fond som använder sig av en dynamisk förvaltningsteknik för att ta del av de globala marknadernas uppgång samtidigt som man undviker de största nedgångarna då de sjunker. Fonden har som målsättning att erbjuda exponering mot de globala kapitalmarknaderna. Fonden är passivt förvaltd. Varje årsskifte bestäms en ny skyddsnivå på 90% av fondandelsvärdet som gäller till nästa årsskifte. Fonden beaktar hållbarhet i sin förvaltning. Bolag som inte uppfyller definierade krav avseende hållbarhet får inte ingå i fonden. Dessa bolag är sådana som är involverade i förbjudna vapen, kärnvapen eller involverade i kränkningar av internationella normer för miljö, mänskliga rättigheter, arbetstagarnas rättigheter eller antikorrupcion. Kraven innefattar även att fonden väljer bort företag involverade i produktion eller distribution av fossila bränslen, krigsmateriel, tobak, alkohol, spel och pornografi. Fonden väljer även in bolag baserat på bolagens hållbarhetsbetyg. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Fonden får placera max 10% av fondförmögenheten i fondandelar.

## Portföljen

Fonden steg med 11,6% under första halvåret 2023\*. Under halvåret 2023 var fondens andel riskfyllda tillgångar, som aktier och råvaror, i genomsnitt 89%. Andelen riskfyllda tillgångar varierade mellan 69% och 100%. Vid halvårsskiftet låg andelen riskfyllda tillgångar på 75%. De tre största aktieinnehaven var Novo Nordisk, Atlas Copco och PNC Financial Services. Den 31 december 2022 justerades fondens skyddsnivå till 90% av fondandelsvärdet per den 30 december 2022. Skyddsnivån justerades upp den 5 juni 2023 då fondens avkastning överstigit 10% dittills under året. Fondens skyddsnivå kan tidigast justeras ned 31 december 2023.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en blandfond som är riskklassificerad med 3 av 7, dvs. en medellåg riskklass. Det betyder att fonden har medellåg risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Riskerna i fonden beror på fondens fördelning mellan "riskbärande tillgångar" och "övriga tillgångar". En investering i aktier, aktiefonder och alternativa investeringar kan vara förenade med hög risk och kan variera kraftigt över tid. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är förenad med ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindningstid har en högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindningstid. Räntebindningstiden på innehaven i fonden kan variera väsentligt över tid. Fonden har möjlighet att placera koncentrerat både avseende region och sektor. Då fondens investeringar sker i utländska värdepapper denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

• Högsta hävstång under räkenskapsåret	0.0%
• Lägsta hävstång under räkenskapsåret	0.0%
• Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret	0.0%

## Information

Fondens avkastningshistorik före startdatum härleds från fusionen (14 december 2018) då handelsbanken Funds Global Dynamic Allocation Preserve 90 (Luxemburg) lades samman med Handelsbanken Global Dynamisk 90 (Sverige).

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan

Handelsbanken Global Dynamisk Strategi, forts.

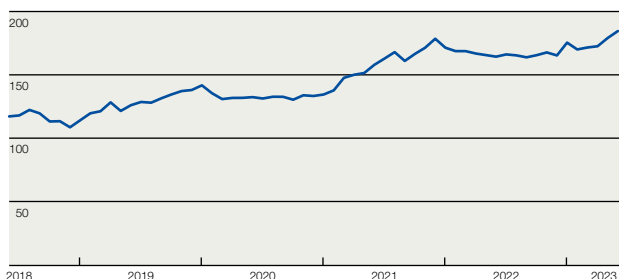
Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de

hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

### Fondens utveckling \*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

### Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Global Dynamisk Strategi A1 - SEK	182,66	163,68	176,69	132,09	136,75	107,68	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi A9 - SEK	186,58	166,87	179,41	133,59	137,74	108,03	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi B1 - SEK	184,92	170,93	190,25	146,58	-	-	-	-	-	-
Fondens totala nettolöde, mnSEK	196	-69	-195	-166	-569	-661	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	1 348	1 022	1 175	1 047	1 254	1 472	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi A1 - SEK	185	60	88	129	198	270	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi A9 - SEK	896	771	878	832	1 050	990	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi B1 - SEK	266	191	209	86	-	-	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	7 257	6 107	6 490	7 795	9 109	13 358	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi A1 - SEK	1 015	367	500	979	1 447	2 504	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi A9 - SEK	4 804	4 622	4 892	6 231	7 622	9 165	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi B1 - SEK	1 439	1 118	1 098	585	-	-	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Global Dynamisk Strategi A1 - SEK	11,6	-7,4	33,8	-3,4	27,0	-5,7	6,1	-	-	-
Global Dynamisk Strategi A9 - SEK	11,8	-7,0	34,3	-3,0	27,5	-5,3	6,5	-	-	-
Global Dynamisk Strategi B1 - SEK	11,5	-7,4	33,8	-3,4	27,0	-5,7	6,1	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Global Dynamisk Strategi A1 - SEK	8,1	11,3	13,7	10,8	9,4	0,0	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi A9 - SEK	8,5	11,8	14,1	11,2	9,9	0,4	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi B1 - SEK	8,0	11,3	13,7	10,8	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Global Dynamisk Strategi A1 - SEK	9,5	7,5	10,4	-	-	-	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi A9 - SEK	9,9	7,9	10,9	-	-	-	-	-	-	-
Global Dynamisk Strategi B1 - SEK	9,5	7,5	10,4	-	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK	5,18	5,37	4,68	-	-	-	-	-	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta - historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Relevant jämförelseindex saknas.

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

### Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Global Dynamisk Strategi A1	0,80
Global Dynamisk Strategi A9	0,40
Global Dynamisk Strategi B1	0,80
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Global Dynamisk Strategi A1	0,80
Global Dynamisk Strategi A9	0,40
Global Dynamisk Strategi B1	0,80
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Global Dynamisk Strategi A1	0,80
Global Dynamisk Strategi A9	0,40
Global Dynamisk Strategi B1	0,80
Transaktionskostnader, tSEK	1 392
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,03

### Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	1,7
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	0,1
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

### Risk- och avkastningsmått \*

Total risk % - A1 SEK	9,1	Sharpekvot - A1 SEK	0,8
Total risk % - A9 SEK	9,1	Sharpekvot - A9 SEK	0,9
Total risk % - B1 SEK	9,1	Sharpekvot - B1 SEK	0,8

Jämförelseindex Relevant jämförelseindex saknas.

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

### Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	1 077 032	79,9	726 813	71,1
OTC-derivatinstrument med positivt marknadsvärde	26	0,0	-	-
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>1 077 057</b>	<b>79,9</b>	<b>726 813</b>	<b>71,1</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	335 570	24,9	813 613	79,6
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	1 380	0,1	650	0,1
Övriga tillgångar	35 694	2,6	462 834	45,3
<b>Summa tillgångar</b>	<b>1 449 701</b>	<b>107,6</b>	<b>2 003 910</b>	<b>196,0</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	571	0,0	435	0,0
Övriga skulder	101 438	7,5	981 015	95,9
<b>Summa skulder</b>	<b>102 009</b>	<b>7,6</b>	<b>981 450</b>	<b>96,0</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>1 347 692</b>	<b>100,0</b>	<b>1 022 460</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	25 768	1,9	23 368	2,3
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	30 543	2,3	25 463	2,5

Handelsbanken Global Dynamisk Strategi, forts.

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 79,9**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>			
Dexus	103 311	5 794	0,4
Stockland Trust Group	340 533	9 867	0,7
		<b>15 661</b>	<b>1,2</b>
<b>BELGIEN</b>			
KBC	24 343	18 336	1,4
		<b>18 336</b>	<b>1,4</b>
<b>DANMARK</b>			
DSV	1 930	4 377	0,3
Genmab	4 624	18 881	1,4
Novo Nordisk	25 365	44 134	3,3
Novozymes	27 873	14 024	1,0
		<b>81 415</b>	<b>6,0</b>
<b>FINLAND</b>			
Orion	13 301	5 959	0,4
		<b>5 959</b>	<b>0,4</b>
<b>FRANKRIKE</b>			
Aéroports de Paris	4 153	6 436	0,5
Dassault Systems	30 040	14 381	1,1
		<b>20 817</b>	<b>1,5</b>
<b>IRLAND</b>			
Delphi Automotive	5 255	5 795	0,4
Seagate Technology Holdings	7 207	4 816	0,4
Trane Technologies	2 333	4 820	0,4
		<b>15 431</b>	<b>1,1</b>
<b>ISRAEL</b>			
Wix.com	2 624	2 218	0,2
		<b>2 218</b>	<b>0,2</b>
<b>ITALIEN</b>			
Terna	65 779	6 051	0,4
		<b>6 051</b>	<b>0,4</b>
<b>JAPAN</b>			
Aeon	15 100	3 320	0,2
Astellas Pharma	66 367	10 658	0,8
Daiichi Sankyo	20 100	6 835	0,5
Daikin Industries	3 100	6 780	0,5
KDDI	44 200	14 699	1,1
Nitto Denko	7 637	6 067	0,5
ONO Pharmaceutical	41 400	8 063	0,6
Rohm	2 600	2 627	0,2
		<b>59 048</b>	<b>4,4</b>
<b>KANADA</b>			
Agnico-Eagle Mines	11 800	6 372	0,5
Bank of Montreal	7 100	6 934	0,5
Cameco	10 161	3 441	0,3
National Bank of Canada	7 000	5 640	0,4
Sun Life Financial	7 500	4 228	0,3
		<b>26 614</b>	<b>2,0</b>
<b>KINA</b>			
Fosun International	869 000	6 444	0,5
		<b>6 444</b>	<b>0,5</b>
<b>NEDERLÄNDERNA</b>			
ASML Holding	783	6 118	0,5
NXP Semiconductors	2 101	4 645	0,3
Wolters Kluwer C	7 661	10 499	0,8
		<b>21 262</b>	<b>1,6</b>
<b>NORGE</b>			
DNB Bank	20 381	4 124	0,3
		<b>4 124</b>	<b>0,3</b>
<b>SCHWEIZ</b>			
Cie Financiere Richemont A	4 940	9 045	0,7
Geberit	2 135	12 066	0,9
Kuehne & Nagel	4 492	14 355	1,1
		<b>35 466</b>	<b>2,6</b>
<b>SPANIEN</b>			
Red Electrica	23 747	4 305	0,3
		<b>4 305</b>	<b>0,3</b>
<b>STORBRITANNIEN</b>			
CNH Industrial	32 568	5 068	0,4
Kingfisher	137 526	4 376	0,3
London Stock Exchange	4 820	5 537	0,4
		<b>14 981</b>	<b>1,1</b>
<b>SVERIGE</b>			
Assa Abloy B	87 337	22 620	1,7
Atlas Copco A	186 875	29 040	2,2
Axfood	24 929	5 689	0,4
Handelsbanken A	194 670	17 586	1,3
Holmen B1	8 737	3 385	0,3
Kinnevik B	23 684	3 538	0,3
NIBE Industrier B	111 457	11 413	0,8
Nordea Bank	77 595	9 102	0,7
Sandvik	84 055	17 668	1,3
		<b>120 042</b>	<b>8,9</b>

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>TYSKLAND</b>			
Beiersdorf	6 834	9 765	0,7
Merck KGaA	6 820	12 180	0,9
Münchener Rück	5 889	23 845	1,8
Telefónica Germany	316 584	9 614	0,7
		<b>55 403</b>	<b>4,1</b>
<b>USA</b>			
Adobe	4 358	23 018	1,7
Agilent	8 240	10 703	0,8
Amgen	8 200	19 664	1,5
Applied Material	4 265	6 659	0,5
Autodesk	2 988	6 604	0,5
Automatic Data Processing	5 277	12 528	0,9
Best Buy	7 410	6 559	0,5
Cadence Design Systems	2 370	6 003	0,4
Cummins	1 655	4 383	0,3
Danaher	3 479	9 019	0,7
DexCom	4 859	6 745	0,5
Dover	2 577	4 110	0,3
Elevance Health	3 005	14 421	1,1
Expeditors International	5 763	7 540	0,6
Fidelity National Information Services	5 712	3 375	0,3
General Mills	18 136	15 025	1,1
Hasbro	6 796	4 754	0,4
Healthpeak Properties	56 298	12 223	0,9
Hilton Worldwide Holdings	5 092	8 005	0,6
Hologic	5 487	4 799	0,4
Home Depot	4 053	13 599	1,0
Huntington Bancshares	22 738	2 648	0,2
Intuit	3 267	16 169	1,2
Keurig Dr Pepper	51 967	17 552	1,3
Keysight Technologies	1 703	3 080	0,2
LAM Research	1 735	12 047	0,9
Marsh & McLennan	11 117	22 584	1,7
Marvell Technology	4 650	3 003	0,2
McCormick	7 261	6 841	0,5
McGraw Hill	5 376	23 279	1,7
Mettler-Toledo	789	11 178	0,8
Moody's	2 284	8 578	0,6
NetApp	3 571	2 947	0,2
Northern Trust	6 772	5 423	0,4
Nvidia	4 085	18 665	1,4
PNC Financial Services Group	18 281	24 870	1,8
Prologis	15 117	20 023	1,5
Prudential Financial	4 995	4 760	0,4
Regions Financial	20 037	3 857	0,3
Rockwell Automation	3 409	12 131	0,9
Roper Industries	1 818	9 441	0,7
Salesforce	6 962	15 886	1,2
ServiceNow	1 003	6 088	0,5
Skyworks Solutions	3 944	4 715	0,3
State Street	21 478	16 977	1,3
Synchrony Financial	11 007	4 033	0,3
T. Rowe Price	16 101	19 482	1,4
Target	3 892	5 545	0,4
Texas Instrument	7 139	13 881	1,0
Vertex Pharmaceuticals	3 256	12 376	0,9
VMware	3 716	5 767	0,4
W.W. Grainger	795	6 772	0,5
Waters	1 327	3 820	0,3
Western Digital	6 609	2 708	0,2
Workday	2 765	6 746	0,5
Xylem	3 067	3 731	0,3
		<b>55 338</b>	<b>41,4</b>
<b>ÖSTERRIKE</b>			
Voestalpine	15 774	6 116	0,5
		<b>6 116</b>	<b>0,5</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>1 077 032</b>	<b>79,9</b>

**Övriga finansiella instrument 0,0**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>OTC-DERIVATINSTRUMENT</b>			
<b>VALUTATERMINER</b>			
AUD/SEK <sup>1)</sup>		2	0,0
CHF/SEK <sup>2)</sup>		6	0,0
DKK/SEK <sup>3)</sup>		3	0,0
EUR/SEK <sup>4)</sup>		6	0,0
GBP/SEK <sup>5)</sup>		2	0,0
HKD/SEK <sup>6)</sup>		0	0,0
JPY/SEK <sup>7)</sup>		7	0,0
NOK/SEK <sup>8)</sup>		0	0,0
		<b>26</b>	<b>0,0</b>
<b>OTC-derivatinstrument</b>		<b>26</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>1 077 057</b>	<b>79,9</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		270 635	20,1
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>1 347 692</b>	<b>100,0</b>

- 1) AUD 181 tSEK -1 299, motpart Svenska Handelsbanken  
2) CHF 146 tSEK -1 757, motpart Svenska Handelsbanken  
3) DKK 2 500 tSEK -3 954, motpart Svenska Handelsbanken  
4) EUR 626 tSEK -7 371, motpart Svenska Handelsbanken  
5) GBP 46 tSEK -630, motpart Nordea Bank  
6) HKD 337 tSEK -464, motpart Svenska Handelsbanken  
7) JPY 64 209 tSEK -4 792, motpart Svenska Handelsbanken  
8) NOK 145 tSEK -146, motpart Svenska Handelsbanken

Handelsbanken Global Dynamisk Strategi, forts.

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

<b>Volym utlånade värdepapper, tSEK</b>	<b>25 768</b>
---	---------------

<b>Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar</b>	<b>2,4</b>
--	------------

**De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:**

Franska staten	3 170
Hsbc Holdings	917
BP	640
Unilever	640
AstraZeneca	640
Rio Tinto	640
Lloyds Banking Group	631
Shell	586
Barclays	550
Relx	550

**De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:**

Svenska Handelsbanken	10 952
UBS AG London Branch	9 313
SEB	7 520
BNP Paribas Arbitrage SNC	1 810
Barclays Capital Securities	948

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:**

Aktier	26 563
Obligationer och andra räntebärande instrument	3 980
<b>30 543</b>	

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	-
En till tre månader	-
Tre månader till ett år	3
Mer än ett år	3 977
Obestämld löptid	26 563
<b>30 543</b>	

**Motparternas hemvist, tSEK**

Frankrike	1 810
Storbritannien	10 261
Sverige	18 472
<b>30 543</b>	

**Säkerheternas valuta, tSEK**

AUD	177
CHF	385
DKK	0
EUR	4 427
GBP	8 095
HKD	371
JPY	5 063
NZD	4
SEK	550
SGD	43
USD	11 430
<b>30 543</b>	

**Avveckling och clearing, tSEK**

Tredje part	30 543
<b>30 543</b>	

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämmd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 52 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Morgan Stanley & Co Intl
- SEB
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch



# Handelsbanken Global High Dividend Low Volatility Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Solactive ISS ESG Global High Div Low Vol Index NTR så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,2%. Förvaltningsavgift, kundflöden, indexrebalansering och företagsändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilka inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet är återinvestering, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet, justerat för skatt. Index består av en korg med högutdelande lågvolatila bolag på aktiemarknaderna globalt. Det index som fonden följer innefattar hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven innebär att index väljer bort bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer samt bolag med produktion eller distribution av fossila bränslen, krigsmateriel, tobak, cannabis, alkohol, kommersiell spelverksamhet och pornografi. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 6,0% under första halvåret 2023\*. Fonden investerar i bolag med hög direktavkastning och låg volatilitet i aktiekursen. De tre största aktieinnehaven vid halvårsskiftet var hälsovårdsbolagen Johnson & Johnson, Bristol-Myers Squibb och Quest Diagnostics. De tre största sektorerna utgjorde drygt 50% av portföljen och bestod av hälsovård, dagligvaror och industrivaror och tjänster. Av fondens tillgångar vid halvårsskiftet var ca 63% placerade i nordamerikanska bolag, 11% i europeiska bolag, 17% i japanska och 9% i övriga asiatiska bolag.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 3 av 7, dvs. en medellåg riskklass. Det betyder att fonden har medellåg risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar sker dock globalt och fördelas över företag i flera sektorer eller branscher vilket bidrar till att minska risken i fonden. Då fondens placeringar sker i utländska aktier denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. Då fonden består av olika andelsklasser kan förändringar i valutakurser medföra att värdet och riskklassificeringen skiljer sig åt mellan olika andelsklasser beroende på vilken valuta andelsklassen handlas i. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

• Högsta hävstång under räkenskapsåret	1,1%
• Lägsta hävstång under räkenskapsåret	0,2%
• Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret	0,6%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fonddrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans

Handelsbanken Global High Dividend Low Volatility Criteria, forts.

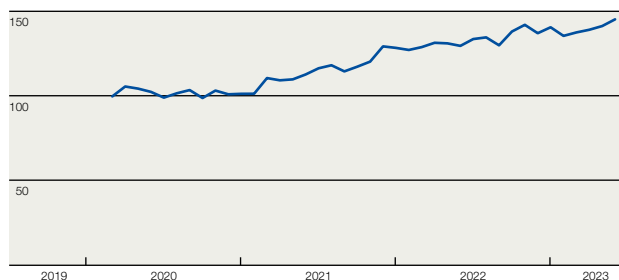
med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas

informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

#### Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

#### Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
<b>Andelsvärde, SEK</b>										
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - SEK	138,47	130,66	123,24	96,26	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - EUR	12,59	12,59	12,82	10,26	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - NOK	135,36	121,91	118,46	99,04	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - SEK	139,85	131,76	123,91	96,50	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - EUR	12,71	12,68	12,88	10,28	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - NOK	136,71	122,95	119,11	99,29	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - SEK	120,58	119,15	117,74	96,26	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - EUR	12,02	12,59	-	-	-	-	-	-	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	57	4 587	316	1 216	-	-	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	7 205	6 747	1 898	1 187	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - SEK	4 596	4 151	1 379	996	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - EUR	11	13	3	1	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - NOK	237	203	85	24	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - SEK	1 530	1 307	5	3	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - EUR	5	10	2	0	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - NOK	91	297	255	124	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - SEK	559	499	114	36	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - EUR	0	0	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Antal andelar totalt, tusental</b>										
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - SEK	33 195	31 771	11 185	10 344	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - EUR	859	1 043	251	94	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - NOK	1 751	1 665	716	247	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - SEK	10 937	9 923	41	30	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - EUR	415	806	135	2	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - NOK	663	2 414	2 140	1 248	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - SEK	4 636	4 192	970	379	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - EUR	1	1	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total avkastning i %<sup>1)</sup></b>										
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - SEK	6,0	6,0	28,0	-3,7	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - EUR	0,1	-1,8	24,9	2,6	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - NOK	11,0	2,9	19,6	-1,0	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - SEK	6,1	6,3	28,4	-3,5	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - EUR	0,2	-1,5	25,3	2,5	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - NOK	11,2	3,2	20,0	-0,7	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - SEK	6,0	6,0	28,0	-3,7	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - EUR	0,1	-1,8	24,9	-	-	-	-	-	-	-
<b>Jämförelseindex inklusive utdelning i %</b>										
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - SEK	6,1	6,5	28,6	-2,3	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - EUR	0,1	-1,4	25,5	4,2	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - NOK	11,3	3,3	20,1	0,5	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - SEK	6,1	6,5	28,6	-2,3	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - EUR	0,1	-1,4	25,5	4,2	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - NOK	11,3	3,3	20,1	0,5	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - SEK	6,1	6,5	28,6	-2,3	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - EUR	0,1	-1,4	25,5	-	-	-	-	-	-	-
<b>Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)</b>										
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - SEK	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - EUR	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - NOK	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - SEK	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - EUR	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - NOK	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - SEK	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - EUR	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %</b>										
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - SEK	13,5	16,5	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - EUR	5,3	10,7	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1 - NOK	12,6	10,9	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - SEK	13,9	16,9	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - EUR	5,7	11,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9 - NOK	13,0	11,3	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - SEK	13,5	16,5	-	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - EUR	5,4	10,8	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %</b>										
SEK	13,9	17,0	-	-	-	-	-	-	-	-
EUR	5,7	11,2	-	-	-	-	-	-	-	-
NOK	13,1	11,4	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Utdelning per andel, SEK</b>										
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - SEK	5,24	5,25	4,54	-	-	-	-	-	-	-
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1 - EUR	0,55	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Omräkningskurs EUR/SEK	11,78	11,12	10,30	10,05	-	-	-	-	-	-

Handelsbanken Global High Dividend Low Volatility Criteria, forts.

Omräkningskurs NOK/SEK	1,01	1,06	1,03	0,96	-
------------------------	------	------	------	------	---

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta – historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

1) En justering har gjorts under 2023, vilket förklarar varför avkastningen mellan andelsklasserna skiljer sig åt. Justeringen påverkar inte det faktiska värdet i andelsklasserna.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Global High Dividend Low Volatility Index

Fondens jämförelseindex utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsdrag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se Information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1	0,60
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9	0,30
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1	0,60
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9	0,30
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Global High Dividend Low Volatility Criteria A1	0,62
Global High Dividend Low Volatility Criteria A9	0,32
Global High Dividend Low Volatility Criteria B1	0,62
Transaktionskostnader, tSEK	2 776
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,02

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,9
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	0,0
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått \*

Total risk % - A1 SEK	9,7	Aktiv avkastning % - B1 EUR	-0,3
Total risk % - A1 EUR	11,3	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk % - A1 NOK	9,0	Informationskvot - A1 EUR	Negativ
Total risk % - A9 SEK	9,7	Informationskvot - A1 NOK	Negativ
Total risk % - A9 EUR	11,3	Informationskvot - A9 SEK	Negativ
Total risk % - A9 NOK	9,0	Informationskvot - A9 EUR	Negativ
Total risk % - B1 SEK	9,7	Informationskvot - A9 NOK	Negativ
Total risk % - B1 EUR	11,3	Informationskvot - B1 SEK	Negativ
Total risk i index % - A1 SEK	9,7	Informationskvot - B1 EUR	Negativ
Total risk i index % - A1 EUR	11,3	Sharpekvot - A1 SEK	1,3
Total risk i index % - A1 NOK	9,0	Sharpekvot - A1 EUR	0,4
Total risk i index % - A9 SEK	9,7	Sharpekvot - A1 NOK	1,3
Total risk i index % - A9 EUR	11,3	Sharpekvot - A9 SEK	1,4
Total risk i index % - A9 NOK	9,0	Sharpekvot - A9 EUR	0,4
Total risk i index % - B1 SEK	9,7	Sharpekvot - A9 NOK	1,3
Total risk i index % - B1 EUR	11,3	Sharpekvot - B1 SEK	1,3
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG	Sharpekvot - B1 EUR	0,4
	Global High Dividend	Sharpekvot i index - A1 SEK	1,4
	Low Volatility Index	Sharpekvot i index - A1 EUR	0,4
Aktiv avkastning % - A1 SEK	-0,4	Sharpekvot i index - A1 NOK	1,3
Aktiv avkastning % - A1 EUR	-0,3	Sharpekvot i index - A9 SEK	1,4
Aktiv avkastning % - A1 NOK	-0,5	Sharpekvot i index - A9 EUR	0,4
Aktiv avkastning % - A9 SEK	-0,1	Sharpekvot i index - A9 NOK	1,3
Aktiv avkastning % - A9 EUR	0,0	Sharpekvot i index - B1 SEK	1,4
Aktiv avkastning % - A9 NOK	-0,1	Sharpekvot i index - B1 EUR	0,4
Aktiv avkastning % - B1 SEK	-0,4		

\* Riskföretag är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	7 186 947	99,7	6 705 866	99,4
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>7 186 947</b>	<b>99,7</b>	<b>6 705 866</b>	<b>99,4</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	7 794	0,1	45 471	0,7
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	13 403	0,2	10 987	0,2
Övriga tillgångar	1 223	0,0	-	-
<b>Summa tillgångar</b>	<b>7 209 368</b>	<b>100,1</b>	<b>6 762 325</b>	<b>100,2</b>
<b>SKULDER</b>				
OTC-derivatinstrument med negativt marknadsvärde	10	0,0	-	-
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>	<b>10</b>	<b>0,0</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	3 150	0,0	3 176	0,0
Övriga skulder	1 224	0,0	12 539	0,2
<b>Summa skulder</b>	<b>4 385</b>	<b>0,1</b>	<b>15 715</b>	<b>0,2</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>7 204 983</b>	<b>100,0</b>	<b>6 746 610</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

POSTER INOM LINJEN				
Utlånade finansiella instrument	372 824	5,2	602 702	8,9
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	406 397	5,6	655 086	9,7
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	2 312	0,0	3 629	0,1

1) Likvida medel 2 312 tSEK

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 99,7**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>			
ANZ Group	55 393	9 443	0,1
Australian Stock Exchange	17 224	7 802	0,1
Brambles	108 879	11 281	0,2
Commonwealth Bank of Australia	17 824	12 850	0,2
CSL	9 781	19 507	0,3
National Australia Bank	69 127	13 106	0,2
Ramsay Health Care	17 513	7 088	0,1
Rio Tinto	18 491	15 248	0,2
Telstra Group	1 001 474	30 962	0,4
Transurban Group	208 966	21 410	0,3
Wesfarmers	20 547	7 289	0,1
Westpac Bank	73 029	11 205	0,2
Woolworths	48 274	13 790	0,2
		<b>180 979</b>	<b>2,5</b>
<b>BELGIEN</b>			
Ackermans	3 669	6 520	0,1
GBL	20 448	17 388	0,2
		<b>23 908</b>	<b>0,3</b>
<b>BERMUDA</b>			
HAL Trust	9 022	12 460	0,2
		<b>12 460</b>	<b>0,2</b>
<b>DANMARK</b>			
Tryg	61 298	14 324	0,2
		<b>14 324</b>	<b>0,2</b>
<b>FINLAND</b>			
Elisa	37 236	21 475	0,3
Nordea Bank	72 244	8 484	0,1
Sampo A	32 414	15 707	0,2
		<b>45 666</b>	<b>0,6</b>
<b>FRANKRIKE</b>			
Axa	32 362	10 306	0,1
Bouygues	45 344	16 436	0,2
Danone	22 985	15 206	0,2
France Télécom	181 917	22 942	0,3
Vinci (Ex S.G.E)	10 884	13 644	0,2
		<b>78 535</b>	<b>1,1</b>
<b>HONGKONG</b>			
Hang Seng Bank	53 100	8 161	0,1
Hkt Trust	686 000	8 614	0,1
MTR	500 500	24 834	0,3
Sun Hung Kai Properties	47 500	6 462	0,1
		<b>48 071</b>	<b>0,7</b>
<b>IRLAND</b>			
CRH	35 767	21 285	0,3
		<b>21 285</b>	<b>0,3</b>
<b>ISRAEL</b>			
Check Point Software Technologies	6 328	8 586	0,1
Plus500	68 298	13 740	0,2
		<b>22 326</b>	<b>0,3</b>
<b>ITALIEN</b>			
Assicurazioni Generali	43 156	9 469	0,1
UnipolSai	439 537	11 758	0,2
		<b>21 227</b>	<b>0,3</b>
<b>JAPAN</b>			
Aeon Mall	107 900	15 006	0,2
AGC	34 100	13 157	0,2
Aisin	38 000	12 572	0,2
Amada	125 400	13 242	0,2
Asahi Kasei	242 200	17 593	0,2
Astellas Pharma	83 300	13 378	0,2
Bridgestone	37 300	16 424	0,2
Brother Industries	46 400	7 280	0,1
Canon	44 700	12 660	0,2
Casio Computer	93 300	8 234	0,1
Central Japan Railway	4 100	5 534	0,1
Chugai Pharmaceuticals	25 500	7 786	0,1
Daiva House Industry	78 600	22 274	0,3
Daiva House REIT	565	11 662	0,2
Daiva Securities Group	340 500	18 838	0,3
East Japan Railway	21 900	13 072	0,2
GLP J-REIT	959	10 184	0,1
Hankyu Hanshin Holdings	52 700	18 727	0,3



Handelsbanken Global High Dividend Low Volatility Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
Haseko	186 900	24 764	0,3	<b>NEDERLÄNDERNA</b>			
Hirose Electric	4 000	5 702	0,1	Ferrovial	30 402	10 379	0,1
Honda	50 600	16 415	0,2	JDE Peet's	29 985	9 632	0,1
Hulic	138 000	12 695	0,2	Koninklijke Ahold Delhaize	34 883	12 850	0,2
Iida Group Holdings	52 400	9 500	0,1	Koninklijke KPN	755 607	29 108	0,4
Isuzu Motors	33 700	4 382	0,1	NN Group	26 655	10 651	0,1
Japan Post Bank	127 800	10 735	0,1	Wolters Kluwer C	10 256	14 056	0,2
Japan Post Holdings	261 400	20 248	0,3			<b>86 676</b>	<b>1,2</b>
Japan Retail Fund Investment	1 664	11 975	0,2	<b>NORGE</b>			
JFE Holdings	80 600	12 348	0,2	Orkla	173 959	13 522	0,2
Kajima	93 000	15 082	0,2	Telenor	88 460	9 703	0,1
Kao	21 600	8 416	0,1			<b>23 225</b>	<b>0,3</b>
KDDI	71 300	23 711	0,3	<b>NYA ZEELAND</b>			
Kewpie	30 900	5 440	0,1	Chorus	314 633	17 541	0,2
Kobayashi Pharmaceutical	19 100	11 163	0,2	Ebos Group	15 367	3 737	0,1
Kuraray	132 000	13 796	0,2	Infratil	193 525	12 998	0,2
Kyocera	17 700	10 306	0,1	Spark New Zealand	601 886	20 273	0,3
Kyushu Railway	87 300	20 205	0,3			<b>54 550</b>	<b>0,8</b>
McDonalds Japan	120 600	50 561	0,7	<b>PORTUGAL</b>			
Medipal Holdings	15 000	2 635	0,0	Portugal	157 375	5 756	0,1
Meiji Holdings	98 300	23 640	0,3			<b>5 756</b>	<b>0,1</b>
Mitsubishi Chemical Group	145 900	9 412	0,1	<b>SCHWEIZ</b>			
Mitsubishi Electric	86 900	13 164	0,2	ABB N	21 739	9 233	0,1
Mitsubishi Gas Chemicals	57 500	8 983	0,1	Holcim	41 262	29 990	0,4
Mitsubishi HC Capital	296 600	18 940	0,3	Nestlé	16 601	21 566	0,3
Nagoya Railroad	19 600	3 386	0,0	Novartis N	24 983	27 146	0,4
NGK Insulators	108 900	13 949	0,2	Roche Holding	3 598	11 881	0,2
Nichirei	57 600	13 262	0,2	SGS	17 341	17 704	0,2
Nintendo	23 800	11 636	0,2	Swisscom N	2 821	18 998	0,3
Nippon Building Fund	380	16 073	0,2	Zurich Finacial Services N	2 754	14 128	0,2
Nippon Meat Packers	65 700	19 153	0,3			<b>150 645</b>	<b>2,1</b>
Nippon Steel & Sumitomo Metal	59 900	13 447	0,2	<b>SINGAPORE</b>			
Nippon Telegraph & Telephone	2 170 000	27 649	0,4	CapitaLand Ascendas REIT	825 500	17 921	0,2
Nippon Television Holdings	163 800	16 758	0,2	CapitaLand Ascott	1 157 100	9 974	0,1
Nisshin Seifun	139 700	18 578	0,3	CapitaMall Trust	690 200	10 521	0,1
Nittera	53 400	11 505	0,2	City Development	258 600	13 870	0,2
Nomura Holdings	421 000	17 216	0,2	DBS Group Holdings	108 000	27 161	0,4
Nomura Real Estate Holdings	20 200	5 154	0,1	Mapletree Industrial Units	1 045 200	18 436	0,3
Nomura Real Estate Master Fund	1 444	17 924	0,2	Oversea-Chinese Banking	388 000	38 027	0,5
Obayashi	199 100	18 509	0,3	Singapore Airlines	785 800	44 842	0,6
Oji Holdings	217 900	8 754	0,1	Singapore Exchange	368 200	28 241	0,4
Orix Jreit REIT	896	11 879	0,2	Singapore Telecommunications	944 500	18 846	0,3
Otsuka Holdings	34 600	13 629	0,2	Suntec Units	2 355 200	24 248	0,3
Ricoh	107 700	9 839	0,1	United Overseas Bank	99 600	22 258	0,3
Santen Pharmaceutical	192 500	17 630	0,2	United Overseas Land	216 900	11 114	0,2
Secom	34 900	25 401	0,4	Venture	177 800	20 874	0,3
Seiko Epson	52 100	8 718	0,1	Wilmar International	616 700	18 704	0,3
Sekisui Chemical	139 200	21 554	0,3			<b>325 035</b>	<b>4,5</b>
Sekisui House	84 600	18 369	0,3	<b>SPANIEN</b>			
Seven Bank	951 000	20 120	0,3	ACS Actividades de Construccion y Servicios	24 945	9 457	0,1
Shimizu	230 500	15 680	0,2	Mapfre	476 197	10 208	0,1
Shionogi	20 900	9 481	0,1	Red Electrica	72 720	13 184	0,2
Softbank	369 400	42 513	0,6	Telefónica	399 698	17 503	0,2
Sohgo Security Services	171 500	10 435	0,1			<b>50 351</b>	<b>0,7</b>
Sumitomo Electric Industries	39 200	5 147	0,1	<b>STORBRIANNIEN</b>			
Taisei	19 300	7 242	0,1	Amcor	611 223	65 888	0,9
Taisho Pharmaceutical	11 500	4 655	0,1	AstraZeneca	6 163	9 543	0,1
Takeda Pharmaceutical	98 000	33 154	0,5	Bunzl	20 740	8 541	0,1
Tobu Railway	36 300	10 466	0,1	CPG	29 743	8 994	0,1
Toho	13 000	5 315	0,1	GSK	27 536	5 251	0,1
Tokyu	44 900	5 820	0,1	Informa	38 577	3 846	0,1
Toshiba	35 500	11 983	0,2	Reckitt Benckister Group	14 419	11 706	0,2
Tosoh	87 500	11 110	0,2	RELX	46 577	16 764	0,2
Toyota Motor	66 000	11 386	0,2	Rio Tinto GBP	18 085	12 381	0,2
Toyota Tsusho	25 600	13 658	0,2	Unilever	19 473	10 957	0,2
United Urban Investment REIT	932	10 127	0,1	United Utilities Group	48 711	6 432	0,1
West Japan Railways	24 300	10 878	0,2	Vodafone Group	1 475 828	14 991	0,2
Yamada Holdings	388 700	12 328	0,2			<b>175 296</b>	<b>2,4</b>
		<b>1 213 312</b>	<b>16,8</b>	<b>SVERIGE</b>			
<b>KANADA</b>				Tele2 B	79 675	7 101	0,1
Bank of Montreal	17 788	17 372	0,2	Telia	384 461	9 093	0,1
Bank of Nova Scotia	39 028	21 115	0,3			<b>16 193</b>	<b>0,2</b>
BCE	63 116	31 118	0,4	<b>TYSKLAND</b>			
Can Apartment Prop Real Esta	28 688	11 910	0,2	Allianz	4 806	12 075	0,2
Canadian Imperial Bank of Commerce	30 311	13 994	0,2	Deutsche Telekom N	78 226	18 415	0,3
Canadian National Railway	17 377	22 755	0,3	Heidelberg Materials	17 856	15 824	0,2
CCL Industries B	9 409	5 001	0,1	Henkel Pref	23 502	20 290	0,3
CGI	7 620	8 689	0,1			<b>66 602</b>	<b>0,9</b>
Choice Properties Real Estate Investment Units	188 051	20 830	0,3	<b>USA</b>			
GM Financial	23 214	7 642	0,1	AbbVie	42 289	61 541	0,9
Great-West Lifeco	29 546	9 278	0,1	Aflac	107 542	81 079	1,1
Hydro One	73 129	22 594	0,3	Amdocs	131 393	140 289	1,9
Intact Financial	10 066	16 806	0,2	AmerisourceBergen	46 084	95 785	1,3
Loblaws Companies	16 736	16 568	0,2	Amgen	58 251	139 692	1,9
Manulife Financial	87 401	17 864	0,2	Becton Dickinson	32 329	92 191	1,3
Metro	42 804	26 142	0,4	Bristol-Myers Squibb	242 729	167 663	2,3
National Bank of Canada	16 585	13 362	0,2	Cardinal Health	87 268	89 142	1,2
Power Corporation of Canada	45 396	13 214	0,2	CME Group	17 879	35 783	0,5
Progressive Waste Solutions CAD	8 786	13 578	0,2	Coca-Cola	184 942	120 296	1,7
Quebecor B	39 924	10 640	0,1	Colgate-Palmolive	130 702	108 761	1,5
Restaurant Brands International	14 464	12 126	0,2	CVS Health	103 058	76 953	1,1
RioCan Real Estate Investment Trust	119 896	18 869	0,3	Dow	129 298	74 382	1,0
Rogers Communications	14 396	7 102	0,1	Electronic Arts	58 679	82 205	1,1
Royal Bank of Canada	30 031	31 014	0,4	Emerson Electric	54 067	52 787	0,7
Sun Life Financial	36 456	20 551	0,3	General Mills	67 703	56 089	0,8
Telus non-Canadian	117 106	24 643	0,3	Gilead Science	89 344	74 375	1,0
Thomson Reuters	15 408	22 495	0,3	IBM	83 176	120 216	1,7
Toronto-Dominion Bank	36 536	24 488	0,3				
Weston George	14 071	17 989	0,2				
		<b>499 751</b>	<b>6,9</b>				

Handelsbanken Global High Dividend Low Volatility Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
J.M. Smucker	31 334	49 979	0,7
Johnson & Johnson	149 321	266 961	3,7
Kellogg's	91 920	66 918	0,9
Keurig Dr Pepper	117 675	39 746	0,6
Kimberly-Clark	69 179	103 162	1,4
LKQ	132 103	83 145	1,2
McDonald's	45 487	146 614	2,0
McKesson	18 252	84 242	1,2
Merck & Co	106 479	132 711	1,8
Mondelez International	115 710	91 162	1,3
Pepsico	60 854	121 746	1,7
Pfizer	252 963	100 222	1,4
Procter & Gamble	63 520	104 109	1,4
Quest Diagnostics	97 454	147 958	2,1
Realty Income	121 970	78 769	1,1
Republic Services	54 499	90 165	1,3
Royal Pharm A	280 825	93 243	1,3
T-Mobile US	25 158	37 745	0,5
The Cigna Group	31 612	95 811	1,3
Verizon Communications	269 303	108 179	1,5
Vulcan Materials	29 245	71 213	1,0
Waste Management	76 751	143 767	2,0
Yum Brands	69 580	104 128	1,4
		<b>4 030 925</b>	<b>55,9</b>
<b>ÖSTERRIKE</b>			
Vienna Insurance Group	26 470	7 471	0,1
Wienerberger	37 457	12 377	0,2
		<b>19 848</b>	<b>0,3</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>7 186 946</b>	<b>99,7</b>

#### Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 0,0

	Underliggande exponering tSEK	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
STOXX EURO ESG-X Sep 2023	17 685	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>

#### Övriga finansiella instrument 0,0

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>ONOTERADE AKTIER</b>			
<b>KANADA</b>			
Thomson Reuters	1	1	0,0
		<b>1</b>	<b>0,0</b>
<b>Onoterade aktier</b>		<b>1</b>	<b>0,0</b>

#### OTC-DERIVATINSTRUMENT

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>VALUTATERMINER</b>			
SEK/EUR <sup>1)</sup>		-3	0,0
SEK/JPY <sup>2)</sup>		-7	0,0
		<b>-10</b>	<b>0,0</b>
<b>OTC-derivatinstrument</b>		<b>-10</b>	<b>0,0</b>

<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>	<b>7 186 947</b>	<b>99,7</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>	<b>-10</b>	<b>0,0</b>
<b>Netto, övriga tillgångar och skulder</b>	<b>18 046</b>	<b>0,3</b>
<b>Total summa fondförmögenhet</b>	<b>7 204 983</b>	<b>100,0</b>

<sup>1)</sup> tSEK 3 532/1EUR -300, motpart Svenska Handelsbanken  
<sup>2)</sup> tSEK 5 000/1JPY -67 000, motpart Svenska Handelsbanken

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

#### Sammanställning, företags- och koncernexponeringar\*

Företag/koncern	% av fondförmögenheten	Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Toyota Group	0,3	Thomson Reuters Corp	0,3

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehar mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

#### Uppgifter om fondens värdepapperslån

<b>Volym utlånade värdepapper, tSEK</b>	<b>372 824</b>
<b>Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar</b>	<b>5,2</b>

#### De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:

Amerikanska staten	211 800
Brittiska staten	73 497
Franska staten	29 036
Tyska staten	2 774
Seven & I Holdings	2 666
BP	2 280
AstraZeneca	2 280
Unilever	2 280
Rio Tinto	2 280
Mitsubishi Electric Corp	2 183

#### De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:

Barclays Capital Securities	71 453
Citigroup Global Markets	71 434
Goldman Sachs International	69 905
UBS AG London Branch	56 047
HSBC Bank	44 574
BNP Paribas Arbitrage SNC	42 212
Merrill Lynch International	37 717
J.P. Morgan Securities	8 011
Svenska Handelsbanken	5 045

#### Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:

Aktier	85 514
Obligationer och andra räntebärande instrument	320 883
	<b>406 397</b>

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

#### Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	9
En till tre månader	0
Tre månader till ett år	36 382
Mer än ett år	284 492
Obestämd löptid	85 514
	<b>406 397</b>

#### Motparternas hemvist, tSEK

Frankrike	42 212
Storbritannien	359 141
Sverige	5 045
	<b>406 397</b>

#### Säkerheternas valuta, tSEK

AUD	487
CHF	5 298
DKK	0
EUR	37 211
GBP	87 579
HKD	8 307
JPY	36 769
NZD	82
SEK	253
SGD	954
USD	229 458
	<b>406 397</b>

#### Avveckling och clearing, tSEK

Tredje part	406 397
	<b>406 397</b>

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

#### Uppgifter om avkastning och kostnad:

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 3 144 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

#### Motparter för värdepappersutlåning under året:

- Barclays Bank
- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- Credit Suisse International
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende sponsrad, garanterad, godkänd, emitterad, marknadsförd, såld eller understödd på något annat sätt av Solactive AG (Solactive) och Solactive lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av dess index, index varumärke eller indexnivå kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. Indexet beräknas och publiceras av Solactive. Solactive gör sitt bästa för att se till att indexet beräknas korrekt. Oavsett skyldigheter gentemot fondens emittent har Solactive ingen skyldighet att påpeka fel i indexet till tredje part, inklusive men inte begränsat till investerare i fonden och/eller finansiella intermedjärer i fonden. Varken offentliggörande av index eller licensiering av index eller index varumärke för användning i samband med fonden utgör någon rekommendation från Solactive att investera kapital i fonden, ej heller utgör det inte på något sätt en försäkring eller åsikt från Solactive avseende eventuella investeringar i denna fond.



# Handelsbanken Global Index Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index NTR så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaldat. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet kommer att efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet av de aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,25%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet är återinvesterande, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet, justerat för skatt. Indexet syftar till att återspegla utvecklingen aktiemarknaderna globalt exklusive de bolag som inte uppfyller indexets hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven i indexet syftar till en minskning av koldioxidutsläppen och bolagen i index väljs ut och viktas på så sätt att indexportföljens utsläpp av växthusgaser anpassas till de långsiktiga globala uppvärmningsmålen i Parisavtalet. Hållbarhetskraven i index innebär vidare att bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer, bolag som avsevärt skadar miljömässiga mål samt bolag som är verksamma inom kontroversiella sektorer inte ingår i index. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 18,5% under första halvåret 2023\*. De tre största aktieinnehaven vid halvårsskiftet var Apple, Microsoft och Alphabet. De tre största sektorerna utgjorde drygt 50% av portföljen och bestod av informationsteknologi, hälsovård och finans. Av fondens tillgångar vid halvårsskiftet var ca 61% placerade i nordamerikanska bolag, 17% i europeiska bolag, 7% i japanska och 15% i asiatiska bolag samt tillväxtmarknadsbolag. Fonden följer ett index som är i linje med Parisavtalets klimatmål så kallat EU Paris Aligned Benchmarks. Denna utveckling är ett viktigt steg på vägen att nå fondbolagets mål om nettoollutsläpp i våra portföljer till år 2040 samt att linjera allt vårt förvaltade kapital i enlighet med Parisavtalets målsättningar.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar sker globalt men med viss koncentration i aktier noterade i USA. Fondens placeringar fördelas över företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Då fondens investeringar sker i utländska aktier denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. Då fonden består av olika andelsklasser kan förändringar i valutakurser medföra att värdet och riskklassificeringen skiljer sig åt mellan olika andelsklasser beroende på vilken valuta andelsklassen handlas i. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av

dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 1,2%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0,5%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0,8%

## Information

Efter Rysslands invasion av Ukraina i slutet av februari 2022 togs beslut att sälja av alla ryska innehav. Försäljning av ryska innehav har dock inte varit möjligt då den ryska börsen varit stängd för utländska investerare. Ryska innehav samt ryska rubel (RUB) är för närvarande värderade till nära noll.

Fondens avkastningshistorik före startdatum härleds från fusionen (14 december 2018) då handelsbanken Funds Global Index Criteria (Luxemburg) lades samman med Handelsbanken Global Index Criteria (Sverige).

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fonddrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Global Index Criteria, forts.

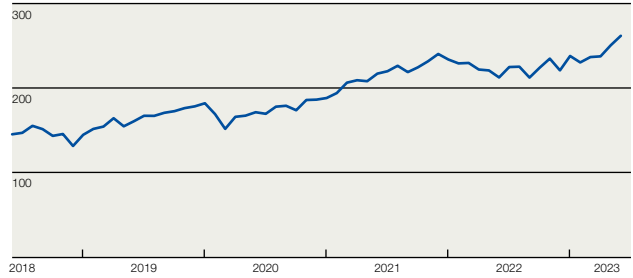
Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

#### Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

#### Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
<b>Andelsvärde, SEK</b>										
Global Index Criteria A1 - SEK	464,87	392,37	426,75	331,02	316,91	233,86	-	-	-	-
Global Index Criteria A1 - EUR	39,45	35,28	41,45	32,94	30,16	23,07	-	-	-	-
Global Index Criteria A1 - NOK	461,10	370,97	415,65	345,10	297,49	228,41	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - SEK	470,73	396,92	430,84	333,52	318,67	234,68	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - EUR	39,95	35,69	41,85	33,19	30,33	23,16	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - NOK	467,53	375,32	419,59	347,65	299,04	229,21	-	-	-	-
Global Index Criteria B1 - SEK	298,70	261,11	294,57	236,73	236,62	177,64	-	-	-	-
<b>Fondens totala nettolöfde, mnSEK</b>										
	7 955	6 162	2 145	3 629	2 947	268	-	-	-	-
<b>Fondförmögenhet totalt, mnSEK</b>										
	86 160	65 252	64 303	46 786	41 274	28 087	-	-	-	-
Global Index Criteria A1 - SEK	63 957	49 583	48 152	34 630	29 762	20 446	-	-	-	-
Global Index Criteria A1 - EUR	581	491	568	446	423	296	-	-	-	-
Global Index Criteria A1 - NOK	1 083	718	731	456	454	211	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - SEK	6 152	2 790	956	680	195	220	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - EUR	74	64	77	74	42	1	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - NOK	0	0	186	0	126	0	-	-	-	-
Global Index Criteria B1 - SEK	7 244	5 943	7 618	5 814	5 575	3 968	-	-	-	-
<b>Antal andelar totalt, tusental</b>										
	193 822	173 814	158 646	148 305	136 443	125 775	-	-	-	-
Global Index Criteria A1 - SEK	137 579	126 368	112 834	104 616	93 911	87 429	-	-	-	-
Global Index Criteria A1 - EUR	14 733	13 917	13 692	13 540	14 025	12 844	-	-	-	-
Global Index Criteria A1 - NOK	2 348	1 936	1 758	1 321	1 526	922	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - SEK	13 069	7 030	2 220	2 039	612	938	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - EUR	1 840	1 803	1 839	2 229	1 391	33	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - NOK	0	0	443	0	420	0	-	-	-	-
Global Index Criteria B1 - SEK	24 252	22 761	25 861	24 560	23 562	22 336	-	-	-	-
<b>Total avkastning i %</b>										
Global Index Criteria A1 - SEK	18,5	-8,1	28,9	4,4	35,5	-2,0	13,1	13,8	4,7	27,4
Global Index Criteria A1 - EUR	11,8	-14,9	25,8	9,2	30,7	-4,9	10,2	8,8	8,3	19,0
Global Index Criteria A1 - NOK	24,3	-10,8	20,4	16,0	30,2	-4,2	19,2	2,7	14,8	29,2
Global Index Criteria A9 - SEK	18,6	-7,9	29,2	4,7	35,8	-1,5	13,6	14,3	5,2	28,0
Global Index Criteria A9 - EUR	11,9	-14,7	26,1	9,4	31,0	-4,5	10,7	9,2	8,8	19,6
Global Index Criteria A9 - NOK	24,6	-10,6	20,7	16,3	30,5	-3,7	19,8	3,2	15,3	29,8
Global Index Criteria B1 - SEK	18,6	-8,1	28,9	4,6	35,5	-1,7	13,4	14,1	5,0	27,8
<b>Jämförelseindex inklusive utdelning i %</b>										
Global Index Criteria A1 - SEK	18,4	-8,1	29,6	4,8	35,7	-1,1	13,6	14,7	5,4	28,2
Global Index Criteria A1 - EUR	11,7	-14,9	26,5	9,6	30,9	-4,1	10,8	9,6	9,1	19,8
Global Index Criteria A1 - NOK	24,2	-10,8	21,1	16,4	30,4	-3,3	19,8	3,5	15,6	30,0
Global Index Criteria A9 - SEK	18,4	-8,1	29,6	4,8	35,7	-1,1	13,6	14,7	5,4	28,2
Global Index Criteria A9 - EUR	11,7	-14,9	26,5	9,6	30,9	-4,1	10,8	9,6	9,1	19,8
Global Index Criteria A9 - NOK	24,2	-10,8	21,1	16,4	30,4	-3,3	19,8	3,5	15,6	30,0
Global Index Criteria B1 - SEK	18,4	-8,1	29,6	4,8	35,7	-1,1	13,6	14,7	5,4	28,2
<b>Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)</b>										
Global Index Criteria A1 - SEK	0,2	0,2	0,1	0,1	0,2	0,2	0,2	0,2	0,2	0,2
Global Index Criteria A1 - EUR	0,2	0,2	0,1	0,1	0,2	0,2	-	-	-	-
Global Index Criteria A1 - NOK	0,2	0,2	0,1	0,1	0,2	0,2	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - SEK	0,2	0,2	0,1	0,1	0,2	0,2	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - EUR	0,2	0,2	0,1	0,1	0,2	0,2	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - NOK	0,2	0,2	0,2	0,2	0,2	0,2	-	-	-	-
Global Index Criteria B1 - SEK	0,2	0,2	0,2	0,2	0,2	0,2	-	-	-	-
<b>Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %</b>										
Global Index Criteria A1 - SEK	9,8	8,9	16,0	19,0	15,3	5,3	13,4	9,2	15,5	26,0
Global Index Criteria A1 - EUR	1,9	3,5	17,2	19,5	11,5	2,4	9,5	8,5	13,5	19,9
Global Index Criteria A1 - NOK	9,0	3,7	18,2	22,9	11,7	6,9	10,7	8,6	21,8	33,4
Global Index Criteria A9 - SEK	10,0	9,1	16,3	19,2	15,6	5,8	13,9	9,6	16,0	26,6
Global Index Criteria A9 - EUR	2,1	3,7	17,5	19,7	11,8	2,8	10,0	9,0	14,1	20,5
Global Index Criteria A9 - NOK	9,3	3,9	18,5	23,2	12,1	7,4	11,1	9,1	22,3	34,0
Global Index Criteria B1 - SEK	9,8	8,8	16,1	19,1	15,4	5,6	13,8	9,5	15,8	26,4
<b>Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %</b>										
SEK	9,9	9,1	16,5	19,3	15,8	6,0	14,2	10,0	16,3	26,7
EUR	2,0	3,8	17,7	19,8	12,0	3,1	10,2	9,4	14,3	20,6
NOK	9,2	3,9	18,7	23,2	12,3	7,6	11,4	9,4	22,6	34,1
<b>Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %</b>										
Global Index Criteria A1 - SEK	12,5	10,5	15,1	12,3	12,4	11,0	16,4	15,6	11,4	11,1

Handelsbanken Global Index Criteria, forts.

Global Index Criteria A1 - EUR	9,8	7,8	13,5	10,2	10,0	8,0	13,3	13,9	11,0	12,9
Global Index Criteria A1 - NOK	14,4	9,3	15,8	12,1	11,9	11,7	20,1	17,6	15,8	15,0
Global Index Criteria A9 - SEK	12,7	10,7	15,5	12,7	12,8	11,5	17,0	16,1	11,9	11,7
Global Index Criteria A9 - EUR	10,0	8,0	13,8	10,6	10,5	8,5	13,8	14,4	11,5	13,4
Global Index Criteria A9 - NOK	14,7	9,5	16,1	12,5	12,3	12,2	20,7	18,1	16,3	15,5
Global Index Criteria B1 - SEK	12,5	10,6	15,3	12,5	12,6	11,3	16,8	15,9	11,7	11,4
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	12,8	10,9	15,7	12,9	13,0	11,7	17,2	16,4	12,2	11,9
EUR	10,1	8,2	14,0	10,8	10,7	8,8	14,0	14,7	11,8	13,7
NOK	14,7	9,7	16,3	12,7	12,6	12,5	20,8	18,4	16,6	15,8
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %										
Global Index Criteria A1 - SEK	14,0	13,4	15,4	11,8	11,7	10,1	-	-	-	-
Global Index Criteria A1 - EUR	10,7	10,5	13,7	10,6	11,4	11,0	-	-	-	-
Global Index Criteria A1 - NOK	15,1	14,6	16,7	14,0	13,4	11,2	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - SEK	14,4	13,8	15,8	12,3	12,2	10,6	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - EUR	11,1	10,9	14,1	11,1	11,9	11,5	-	-	-	-
Global Index Criteria A9 - NOK	15,5	15,0	17,1	14,4	13,9	11,7	-	-	-	-
Global Index Criteria B1 - SEK	14,2	13,6	15,6	12,1	12,0	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	14,5	14,0	16,1	12,5	12,5	11,0	-	-	-	-
EUR	11,2	11,0	14,4	11,3	12,2	11,9	-	-	-	-
NOK	15,6	15,1	17,4	14,6	14,2	12,1	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK	9,49	9,63	8,91	9,46	3,55	-	-	-	-	-
Omräkningskurs EUR/SEK	11,78	11,12	10,30	10,05	10,51	10,13	-	-	-	-
Omräkningskurs NOK/SEK	1,01	1,06	1,03	0,96	1,07	1,02	-	-	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta – historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index

T o m 2019-02-28: MSCI ACWI Select Global Norms and Criteria Index

T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevantt branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Global Index Criteria A1	0,40
Global Index Criteria A9	0,20
Global Index Criteria B1	0,40
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Global Index Criteria A1	0,40
Global Index Criteria A9	0,20
Global Index Criteria B1	0,40
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Global Index Criteria A1	0,41
Global Index Criteria A9	0,21
Global Index Criteria B1	0,41
Transaktionskostnader, tSEK	12 201
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,04

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,1
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	0,0
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått \*

Total risk % - A1 SEK	13,5	Aktiv avkastning % - B1 SEK	-0,1
Total risk % - A1 EUR	14,6	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk % - A1 NOK	12,1	Informationskvot - A1 EUR	Negativ
Total risk % - A9 SEK	13,5	Informationskvot - A1 NOK	Negativ
Total risk % - A9 EUR	14,6	Informationskvot - A9 SEK	0,4
Total risk % - A9 NOK	12,2	Informationskvot - A9 EUR	0,4
Total risk % - B1 SEK	13,5	Informationskvot - A9 NOK	0,7
Total risk i index % - A1 SEK	13,4	Informationskvot - B1 SEK	Negativ
Total risk i index % - A1 EUR	14,5	Sharpekvot - A1 SEK	0,7
Total risk i index % - A1 NOK	12,1	Sharpekvot - A1 EUR	0,1
Total risk i index % - A9 SEK	13,4	Sharpekvot - A1 NOK	0,6
Total risk i index % - A9 EUR	14,5	Sharpekvot - A9 SEK	0,7
Total risk i index % - A9 NOK	12,1	Sharpekvot - A9 EUR	0,1
Total risk i index % - B1 SEK	13,4	Sharpekvot - A9 NOK	0,7
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG	Sharpekvot - B1 SEK	0,7
	Screened Paris Aligned	Sharpekvot i index - A1 SEK	0,7
	Global Markets Index	Sharpekvot i index - A1 EUR	0,1
Aktiv avkastning % - A1 SEK	-0,1	Sharpekvot i index - A1 NOK	0,7
Aktiv avkastning % - A1 EUR	-0,1	Sharpekvot i index - A9 SEK	0,7
Aktiv avkastning % - A1 NOK	-0,1	Sharpekvot i index - A9 EUR	0,1
Aktiv avkastning % - A9 SEK	0,1	Sharpekvot i index - A9 NOK	0,7
Aktiv avkastning % - A9 EUR	0,1	Sharpekvot i index - B1 SEK	0,7
Aktiv avkastning % - A9 NOK	0,2		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	85 577 799	99,3	64 656 165	99,1
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>85 577 799</b>	<b>99,3</b>	<b>64 656 165</b>	<b>99,1</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	589 777	0,7	689 788	1,1
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	104 919	0,1	66 285	0,1
Övriga tillgångar	75 493	0,1	151 984	0,2
<b>Summa tillgångar</b>	<b>86 347 988</b>	<b>100,2</b>	<b>65 564 222</b>	<b>100,5</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	26 905	0,0	21 672	0,0
Övriga skulder	161 462	0,2	290 087	0,4
<b>Summa skulder</b>	<b>188 367</b>	<b>0,2</b>	<b>311 759</b>	<b>0,5</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>86 159 621</b>	<b>100,0</b>	<b>65 252 462</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	3 051 959	3,5	3 089 854	4,7
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	3 340 302	3,9	3 356 561	5,1
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	42 475	0,0	38 325	0,1

1) Likvida medel 42 475 tSEK

## Fondens innehav av finansiella instrument

## Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 99,3

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>			
ANZ Group	344 402	58 711	0,1
Australian Stock Exchange	29 229	13 240	0,0
BlueScope Steel	35 850	5 297	0,0
Brambles	531 689	55 086	0,1
Cochlear	14 372	23 670	0,0
Commonwealth Bank of Australia	239 761	172 851	0,2
Computershare	16 252	2 732	0,0
CSL	70 370	140 341	0,2
Dexus	283 633	15 906	0,0
Evolution Mining	497 387	11 515	0,0
Fortescue Metals Group	85 361	13 613	0,0
Goodman Group	332 113	47 924	0,1
GPT Group	616 446	18 349	0,0
IGO	206 076	22 521	0,0
Insurance Australia Group	183 323	7 513	0,0
Lend Lease	164 829	9 185	0,0
Macquarie Group	51 514	65 787	0,1
Medibank Private	261 572	6 620	0,0
Mineral Resources	60 334	30 986	0,0
Mirvac Group	990 208	16 090	0,0
National Australia Bank	414 256	78 542	0,1
Newcrest Mining	151 410	28 761	0,0
Northern Star Resources	200 860	17 445	0,0
Orica	148 631	15 848	0,0
Qantas Airways	118 960	5 303	0,0

Handelsbanken Global Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.	
<b>QBE Insurance Group</b>					<b>DANMARK</b>			
Ramsay Health Care	151 961	17 121	0,0	A.P. Møller-Mærsk A	328	6 167	0,0	
REA Group	8 390	8 628	0,0	A.P. Møller-Mærsk B	720	13 646	0,0	
Reece	46 540	6 214	0,0	Chr. Hansen Holding	22 910	17 172	0,0	
Scentre Group	1 192 531	22 722	0,0	Coloplast B	18 578	25 086	0,0	
Seek	24 740	3 864	0,0	Danske Bank	81 071	21 299	0,0	
Seven Group Holdings	86 994	15 418	0,0	Dong Energy	31 005	31 640	0,0	
Sonic Healthcare	31 584	8 077	0,0	DSV	31 406	71 227	0,1	
Stockland Trust Group	560 229	16 233	0,0	Genmab	7 610	31 073	0,0	
Suncorp-Metway	159 528	15 473	0,0	Novo Nordisk	247 402	430 469	0,5	
Telstra Group	1 448 915	44 795	0,1	Novozymes	35 527	17 874	0,0	
Transurban Group	526 218	53 914	0,1	Pandora Holding	12 953	12 489	0,0	
Vicinity Centres	666 069	8 836	0,0	Tryg	16 348	3 820	0,0	
Wesfarmers	161 390	57 253	0,1	Vestas Wind Systems	157 573	45 253	0,1	
Westpac Bank	430 095	65 990	0,1	William Demant	15 896	7 258	0,0	
WiseTech Global	8 580	4 923	0,0			<b>734 472</b>	<b>0,9</b>	
Woolworths	155 426	44 398	0,1					
		<b>1 284 063</b>	<b>1,5</b>	<b>FILIPPINERNA</b>				
<b>BELGIEN</b>					<b>FINLAND</b>			
Ackermans	7 000	12 439	0,0	Ayala Land	8 433 967	40 103	0,0	
Ageas	24 280	10 618	0,0	Bank of the Philippine Islands	418 001	8 899	0,0	
Azelis Group	47 972	11 804	0,0	BDO Unibank	374 844	10 100	0,0	
Dieteren Group	9 874	18 838	0,0	Globe Telecom	9 464	3 206	0,0	
Elia Group	12 260	16 802	0,0	International Container Terminal Services	521 020	20 778	0,0	
GBL	8 710	7 407	0,0	Jollibee Foods	53 700	2 513	0,0	
KBC	42 126	31 731	0,0	Metrobank	562 416	6 130	0,0	
Proximus	62 225	5 004	0,0	PLDT	8 470	2 174	0,0	
Sofina	2 440	5 455	0,0	SM Investments	201 330	36 441	0,0	
Solvay	14 297	17 235	0,0	SM Prime Holdings	3 509 800	22 561	0,0	
UCB	32 311	30 918	0,0	Universal Robina	340 310	9 156	0,0	
Umicore	58 588	17 668	0,0			<b>162 062</b>	<b>0,2</b>	
Warehouses de Pauw REIT	47 295	14 000	0,0					
		<b>199 919</b>	<b>0,2</b>	<b>FRANKRIKE</b>				
<b>BERMUDA</b>					<b>FRANKRIKE</b>			
Arch Capital Group	46 300	37 432	0,0	Aéroports de Paris	22 374	34 671	0,0	
Everest Reinsurance Group	5 764	21 284	0,0	Air Liquide	77 508	149 976	0,2	
HAL Trust	9 304	12 850	0,0	Axa	293 881	93 592	0,1	
Hongkong Land	582 300	24 529	0,0	Biomerieux	7 828	8 867	0,0	
		<b>96 096</b>	<b>0,1</b>	BNP Paribas	171 889	116 916	0,1	
<b>BRASILIEN</b>					Bouygues	54 026	19 583	0,0
Atacadao Carrefour	426 300	10 691	0,0	Capgemini	24 023	49 131	0,1	
B3 Brasil Bolsa Balcao	862 100	28 202	0,0	Carrefour	93 501	19 122	0,0	
Banco Bradesco	267 937	8 783	0,0	Crédit Agricole	232 586	29 798	0,0	
Banco Bradesco Pref	802 068	29 542	0,0	Danone	91 268	60 380	0,1	
Banco BTG Pactual	184 100	12 964	0,0	Dassault Systems	98 402	47 108	0,1	
Banco do Brasil	91 600	10 132	0,0	Engie	98 638	17 701	0,0	
Banco Santander Brasil	157 000	10 768	0,0	EssilorLuxottica	43 947	89 386	0,1	
BB Seguridade Participacoes	74 200	5 112	0,0	France Télécom	244 292	30 809	0,0	
CCR	823 200	25 897	0,0	Hermes	5 345	125 343	0,1	
CPFL Energia	76 200	5 868	0,0	Kering	12 454	74 202	0,1	
Energisa	85 400	9 599	0,0	L'Oreal	37 746	189 977	0,2	
Equatorial Energia	426 900	30 731	0,0	Legrand Holding	51 169	54 751	0,1	
Hapvida	253 315	2 484	0,0	Michelin	95 692	30 514	0,0	
Hypermarcas	322 600	33 234	0,0	Saint Gobain	60 116	39 480	0,0	
Itaú Unibanco Holding	126 000	6 918	0,0	Sanofi	164 377	190 219	0,2	
Itaú Unibanco Holding Pref	238 600	15 183	0,0	Sartorius Stedim Biotech	10 654	28 713	0,0	
Itaúsa	848 722	18 319	0,0	Schneider Electric	78 902	154 774	0,2	
Klabin	699 600	34 102	0,0	Société Générale	143 861	40 348	0,0	
Localiza Rent a Car (Rent3)	103 179	15 825	0,0	Sodexo	13 960	16 591	0,0	
Lojas Renner	196 142	8 784	0,0	Teleperformance	6 600	11 935	0,0	
Magazine Luiza N	237 100	1 789	0,0	Vinci (Ex S.G.E)	85 046	106 614	0,1	
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios	391 700	24 268	0,0	Worldline	25 960	10 248	0,0	
Natura & Co Holding	43 786	1 641	0,0			<b>1 840 751</b>	<b>2,1</b>	
Raia Drogasil	444 392	29 453	0,0	<b>FÄRÖARNA</b>				
Rumo	533 200	26 504	0,0	Bakkafrost	24 176	15 648	0,0	
Sabesp	211 500	26 790	0,0			<b>15 648</b>	<b>0,0</b>	
Sendas Distribuidora	73 000	2 247	0,0	<b>FÖRENADE ARABEMIRATEN</b>				
Siderúrgica Nacional	14 000	380	0,0	Abu Dhabi Commercial Bank	390 744	9 319	0,0	
Suzano	392 863	38 898	0,0	Emaar Properties	186 140	3 509	0,0	
Telefonica Brasil	70 200	6 801	0,0	Emirates Telecommunications	60 930	4 014	0,0	
WEG	368 800	31 173	0,0	National Bank of Abu Dhabi	445 073	17 852	0,0	
		<b>513 082</b>	<b>0,6</b>			<b>34 693</b>	<b>0,0</b>	
<b>CAYMANÖARNAN</b>					<b>GREKLAND</b>			
Airtac International Group	72 065	25 618	0,0	Eurobank Ergasias	317 970	5 654	0,0	
Kingsoft	36 000	1 531	0,0	FF Group	13 900	786	0,0	
Li Auto A	167 800	31 339	0,0	Hellenic Telecom	95 025	17 592	0,0	
PagSeguro A	14 600	1 489	0,0	Jumbo	190 853	56 676	0,1	
PDD Holdings ADR	108 319	80 893	0,1	National Bank of Greece	209 082	14 670	0,0	
StoneCo A	20 800	2 862	0,0	Star Bulk Carriers	40 300	7 705	0,0	
XP A	23 375	5 923	0,0			<b>103 083</b>	<b>0,1</b>	
Zhen Ding Technology	134 300	4 891	0,0	<b>HONGKONG</b>				
		<b>154 545</b>	<b>0,2</b>	AIA Group	1 589 897	173 338	0,2	
<b>CHILE</b>					Alibaba Health Information Technology	646 000	4 194	0,0
Banco de Chile	3 831 690	4 318	0,0	Beijing Enterprises Water Group	2 658 000	6 814	0,0	
Banco de Crédito e Inversiones	3 606	1 190	0,0	BOC Hong Kong Holdings	553 960	18 287	0,0	
Banco Santander Chile	11 952 920	6 106	0,0	China Everbright	601 592	2 562	0,0	
CMPC	45 220	934	0,0	China Mengniu Dairy	459 402	18 679	0,0	
S.A.C.I. Falabella	77 020	1 996	0,0	China Merchants Port Holding	1 030 000	15 701	0,0	
Sociedad Química y Minera	17 743	13 953	0,0	China Overseas Land & Investment	850 000	20 010	0,0	
Vapores	16 030 420	11 753	0,0					
		<b>40 250</b>	<b>0,0</b>					
<b>COLOMBIA</b>								
Bancolombia	42 949	3 444	0,0					
Bancolombia Pref	105 978	7 673	0,0					
Interconexión Eléctrica	289 841	12 663	0,0					
		<b>23 780</b>	<b>0,0</b>					

Handelsbanken Global Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
China Resources Cement	222 000	988	0,0	Wipro	227 331	11 648	0,0
China Resources Land	511 100	23 388	0,0	Zydrup Lifesciences	215 408	16 536	0,0
China State Construction	581 925	7 163	0,0			<b>1 540 152</b>	<b>1,8</b>
China Taiping Insurance Holdings	92	1	0,0	INDONESIEN			
Chow Tai Fook Jewellery Group	454 000	8 811	0,0	Aneka Tambang	2 982 500	4 190	0,0
Franshion Properties China	1 672 000	2 650	0,0	Bank Artos Indonesia	391 300	896	0,0
Geely Automobile Holdings	703 000	9 263	0,0	Bank Central Asia	6 616 500	43 617	0,1
Hang Lung Properties	1 050 000	17 511	0,0	Bank Mandiri	6 539 600	24 499	0,0
Hang Seng Bank	129 000	19 825	0,0	Bank Negara Indonesia	1 965 400	12 956	0,0
Hkt Trust	705 000	8 852	0,0	Bank Rakyat Indonesia	8 779 846	34 315	0,0
Hong Kong Exchanges and Clearing	141 808	57 699	0,1	Charoen Pokphand	1 255 900	4 773	0,0
MTR	511 095	25 360	0,0	Indah Kiat Pulp & Paper	1 067 200	6 535	0,0
New World Development N1	526 750	13 998	0,0	Indocement Tunggal Prakarsa	649 000	4 641	0,0
Shimao Group Holdings	128 380	782	0,0	Indofood CBP	2 078 300	16 957	0,0
Silicon Motion Technology ADR	19 700	15 291	0,0	Kalbe Farma	9 337 800	13 791	0,0
Sino Biopharmaceutical	2 056 312	9 665	0,0	Semen Indonesia	489 478	2 142	0,0
Sino Land	1 524 856	20 240	0,0	Telkom Indonesia	1 983 200	5 715	0,0
Sun Hung Kai Properties	323 916	44 065	0,1	Tower Bersama Infrastructure	10 624 600	15 385	0,0
Swire Pacific A	64 914	5 373	0,0	Unilever Indonesia	5 807 500	17 824	0,0
Swire Properties	625 186	16 596	0,0			<b>208 238</b>	<b>0,2</b>
Techtronic Industries	173 500	20 363	0,0	IRLAND			
The Link REIT	576 829	34 585	0,0	Accenture	91 390	304 609	0,4
WH Group	616 197	3 525	0,0	AerCap	24 700	16 947	0,0
Wharf Holdings	486 205	12 478	0,0	Aon	27 726	103 379	0,1
Wharf Real Estate Investment	432 000	23 311	0,0	CRH	101 457	60 377	0,1
Xinyi Glass Holdings	271 000	4 557	0,0	Delphi Automotive	61 535	67 855	0,1
		<b>665 925</b>	<b>0,8</b>	Experian	131 502	54 500	0,1
INDIEN				Horizon Therapeutics	46 876	52 075	0,1
Adani Green Energy	99 389	12 378	0,0	Icon	8 300	22 431	0,0
Alkem Laboratories	37 820	17 492	0,0	James Hardie Industries	69 301	19 806	0,0
Ambuja Cements	75 140	4 214	0,0	Johnson Controls	96 995	71 388	0,1
Apollo Hospitals Enterprise	7 920	5 316	0,0	Kerry Group	24 856	26 180	0,0
Ashok Leyland	408 188	8 997	0,0	Kingspan Group	25 260	18 128	0,0
Asian Paints	107 936	47 779	0,1	Linde	74 076	304 909	0,4
AU Small Finance Bank	61 682	6 121	0,0	Medtronic	195 344	185 888	0,2
Aurobindo Pharma	150 992	14 460	0,0	Ryanair	236 956	48 070	0,1
Avenue Supermarts	53 381	27 335	0,0	Seagate Technology Holdings	87 888	58 733	0,1
Axis Bank	258 960	33 668	0,0	Smurfit Kappa Group	41 076	14 778	0,0
Bajaj Auto	27 179	16 789	0,0	Trane Technologies	32 720	67 595	0,1
Bajaj Finserv	17 100	3 440	0,0			<b>1 497 649</b>	<b>1,7</b>
Berger Paints India	180 711	16 134	0,0	ISRAEL			
Bharti Airtel	327 366	37 876	0,0	Airport City	101 730	14 426	0,0
Biocon	290 673	10 161	0,0	Alony-Hetz Properties & Investments	172 874	14 522	0,0
Bosch	10 187	25 541	0,0	Azrieli Group	16 298	9 867	0,0
Britannia Industries	42 340	28 010	0,0	Big Shopping Centers	14 712	14 272	0,0
Cholaman Invest	47 060	7 076	0,0	Check Point Software Technologies	16 727	22 696	0,0
Cipla	184 445	24 648	0,0	Cyber Ark Software	3 952	6 673	0,0
Colgate-Palmolive India	84 380	18 755	0,0	Energix Renewable Energies	409 470	14 302	0,0
Container Corporation Of India	178 405	15 545	0,0	Fiverr	4 300	1 208	0,0
Dabur	265 600	20 036	0,0	Global E Online	73 825	32 646	0,0
Delhivery	42 560	2 135	0,0	Inmode	13 161	5 310	0,0
Divi's Laboratories	45 519	21 477	0,0	Maytronics	115 529	17 028	0,0
DLF	355 852	22 984	0,0	Melisron	18 668	13 041	0,0
Dr. Reddy's Laboratories	38 038	25 841	0,0	Mivne Real Estate KD	464 625	12 200	0,0
Eicher Motors	34 670	16 343	0,0	Nice	4 035	8 891	0,0
Embassy Office	430 214	16 521	0,0	Nova	25 946	31 658	0,0
Godrej Consumer Products	143 479	20 421	0,0	Plus500	24 261	4 881	0,0
Godrej Prop	138 688	28 640	0,0	Shufersal	193 867	10 919	0,0
Havells India	51 536	8 704	0,0	Strauss Group	53 460	12 984	0,0
HCL Technologies	141 682	22 161	0,0	Teva Pharmaceutical Industries	286 312	23 292	0,0
HDFC Asset Management	15 682	4 740	0,0	Teva Pharmaceutical Industries ADR	2 800	228	0,0
HDFC Standard	86 890	7 450	0,0	Tower Semiconductor	16 991	6 760	0,0
Hero Motocorp	17 519	6 713	0,0	Wix.com	6 000	5 071	0,0
Hindustan Unilever	144 650	51 006	0,1			<b>282 874</b>	<b>0,3</b>
Housing Development Finance	229 290	85 193	0,1	ITALIEN			
ICI/CI Bank	732 858	90 181	0,1	Amplifon	33 722	13 348	0,0
ICI/CI Lombard General Insurance	35 423	6 270	0,0	Assicurazioni Generali	134 970	29 615	0,0
ICI/CI Prudential Life Insurance	30 180	2 275	0,0	Banca Mediolanum	102 676	10 021	0,0
Info Edge India	8 190	4 835	0,0	DiaSorin	1 470	1 653	0,0
Infosys Technologies	506 482	89 059	0,1	Enel	937 110	68 114	0,1
Interglobe Avia	27 930	9 660	0,0	Ferrari	21 642	76 383	0,1
Jubilant FoodWorks	56 293	3 715	0,0	FincoBank	102 239	14 837	0,0
Kotak Mahindra Bank	121 268	29 483	0,0	Intesa SanPaolo	2 317 461	65 543	0,1
LTIIMindtree	7 243	4 956	0,0	INWIT	58 149	8 278	0,0
Lupin Laboratories	81 695	9 710	0,0	Mediobanca	137 019	17 697	0,0
Mahindra & Mahindra	137 582	26 332	0,0	Moncler	65 080	48 577	0,1
Marico	251 556	17 586	0,0	Nexi N	135 760	11 490	0,0
Maruti Suzuki India	28 632	36 903	0,0	Pirelli & C	134 650	7 178	0,0
Mphasis	10 400	2 595	0,0	Poste Italiane	146 676	17 139	0,0
MRF	510	6 800	0,0	Prada	418 400	30 276	0,0
Nestle India	9 785	29 496	0,0	Prysmian	24 943	11 252	0,0
Page Industries	2 843	14 092	0,0	Recordati	40 232	20 742	0,0
Patanjali Foods	259	41	0,0	Telecom Italia	2 696 049	8 191	0,0
PI Industries	40 374	20 847	0,0	Telecom Italia R	2 114 842	6 220	0,0
Pidlite Industries	70 598	24 141	0,0	Terna	429 442	39 503	0,0
Power Grid Corporation of India	814 543	27 364	0,0	Unicredit	316 497	79 311	0,1
Samvardhana Motherson	153 180	1 728	0,0			<b>585 368</b>	<b>0,7</b>
SBI Cards	24 080	2 686	0,0	JAPAN			
Sbilite Equity	35 410	6 093	0,0	ABC-Mart	11 200	6 534	0,0
Shree Cement	2 321	7 300	0,0	Acom	14 100	368	0,0
Shriram Finance	24 540	5 607	0,0	Advantest	27 000	38 640	0,0
Siemens India	57 961	28 743	0,0	Aeon	114 900	25 262	0,0
SRF	57 039	17 194	0,0	Aeon Mall	73 200	10 180	0,0
Sun Pharmaceutical	254 581	35 249	0,0	AGC	11 100	4 283	0,0
Tata Consultancy Services	135 276	58 817	0,1	Aisin	27 956	9 249	0,0
Tata Global Beverages	195 096	22 114	0,0	Ajinomoto	69 954	29 924	0,0
Tata Motors	618 579	48 505	0,1	Alfresa Holdings	44 600	7 179	0,0
Tech Mahindra	85 355	12 709	0,0	Amada	94 100	9 937	0,0
Titan Industries	102 401	41 090	0,0	ANA Holdings	44 199	11 316	0,0
Torrent Pharmaceuticals	44 460	11 151	0,0	Asahi Intecc	16 900	3 550	0,0
United Phosphorus	127 550	11 547	0,0				
Vedant Fashions	18 344	2 993	0,0				

Handelsbanken Global Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
Asahi Kasei	192 284	13 967	0,0	Marui Group	70 200	13 157	0,0
Asics	9 800	3 238	0,0	McDonalds Japan	5 600	2 348	0,0
Astellas Pharma	229 777	36 902	0,0	Medipal Holdings	24 300	4 269	0,0
Baycurrent Consulting	6 000	2 407	0,0	Meiji Holdings	45 800	11 014	0,0
Bridgestone	71 965	31 687	0,0	Mercari	145 800	36 599	0,0
Brother Industries	72 500	11 375	0,0	Minebea	102 146	20 649	0,0
Calbee	39 700	8 091	0,0	MISUMI Group	34 300	7 354	0,0
Canon	182 912	51 807	0,1	Mitsubishi Chemical Group	101 224	6 530	0,0
Capcom	28 500	12 129	0,0	Mitsubishi Electric	251 200	38 052	0,0
Casio Computer	59 817	5 279	0,0	Mitsubishi Estate	192 039	24 541	0,0
Central Japan Railway	26 421	35 659	0,0	Mitsubishi HC Capital	133 100	8 499	0,0
Century Tokyo Leasing	4 900	1 895	0,0	Mitsubishi Motors	12 300	461	0,0
Chiba Bank	63 000	4 114	0,0	Mitsubishi Uji Financial Group	1 403 254	111 683	0,1
Chugai Pharmaceuticals	137 454	41 972	0,0	Mitsui Chemicals	24 700	7 806	0,0
Coca-Cola West Japan	58 100	6 617	0,0	Mitsui Fudosan	136 877	29 260	0,0
Concordia Financial Group	107 386	4 515	0,0	Mitsui O.S.K. Lines	23 400	6 044	0,0
Cosmos Pharmaceutical	7 400	8 057	0,0	Miura	21 300	5 953	0,0
CyberAgent	15 000	1 175	0,0	Mizuho Financial Group	266 083	43 727	0,1
Dai-ichi Life Insurance	95 378	19 516	0,0	MonotaRO	86 700	11 812	0,0
Dai-Nippon Printing	38 204	11 643	0,0	MS&AD Insurance Group Holdings	60 786	23 149	0,0
Daifuku	68 300	15 019	0,0	Murata Manufacturing	99 135	61 016	0,1
Daiichi Sankyo	293 145	99 677	0,1	Nabtesco	64 700	15 274	0,0
Daikin Industries	14 200	31 056	0,0	Nagoya Railroad	57 199	9 883	0,0
Dainippon Screen	11 500	13 957	0,0	Namco Bandai Holdings	91 304	22 660	0,0
Daito Trust Construction	8 282	9 027	0,0	NEC	27 394	14 259	0,0
Daiwa House Industry	69 997	19 836	0,0	Nexon	77 509	15 912	0,0
Daiwa House REIT	320	6 605	0,0	NGK Insulators	43 200	5 533	0,0
Daiwa Securities Group	172 332	9 534	0,0	Nichirei	34 000	7 828	0,0
Denso	61 759	44 515	0,1	Nidec	80 800	47 370	0,1
Dentsu Group	23 461	8 263	0,0	Nihon M&A Center Holdings	31 900	2 619	0,0
Disco	16 300	27 542	0,0	Nikon	141 060	19 581	0,0
Don Quijote	61 700	11 864	0,0	Nintendo	205 800	100 614	0,1
East Japan Railway	47 299	28 232	0,0	Nippon Building Fund	180	7 614	0,0
Ebara	18 000	9 232	0,0	Nippon Meat Packers	25 799	7 521	0,0
Eisai	40 468	29 408	0,0	Nippon Paint	141 000	12 465	0,0
Fanuc	141 975	53 389	0,1	Nippon Prologis REIT	230	4 973	0,0
Fast Retailing	23 832	65 398	0,1	Nippon Shinyaku	16 000	7 024	0,0
Fuji Electric	58 800	27 640	0,0	Nippon Telegraph & Telephone	6 776 400	86 343	0,1
Fuji Heavy Industries	29 000	5 858	0,0	Nippon Television Holdings	8 600	880	0,0
FujiFilm Holdings	51 197	32 678	0,0	Nippon Yusen	63 900	15 233	0,0
Fukuoka Financial Group	18 941	4 208	0,0	Nissan Chemical Industries	19 500	8 990	0,0
GLP J-REIT	550	5 841	0,0	Nissan Motor	235 375	10 346	0,0
GMO Payment Gateway	3 000	2 511	0,0	Nisshin Seifun	50 350	6 696	0,0
Hakuhodo DY Holdings	10 200	1 153	0,0	Nissin Food Products	13 600	12 105	0,0
Hamamatsu Photonics	31 300	16 434	0,0	Niterra	60 300	12 992	0,0
Hankyu Hanshin Holdings	56 125	19 944	0,0	Nitori Holdin	9 250	11 133	0,0
Harmonic Drive Systems	8 200	2 825	0,0	Nitto Denko	19 892	15 802	0,0
Hikari Tsushin	3 006	4 628	0,0	NK&J Holdings	39 228	18 935	0,0
Hino Motors	71 318	3 250	0,0	Nomura Holdings	393 240	16 081	0,0
Hirose Electric	10 000	14 255	0,0	Nomura Real Estate Holdings	135 900	34 673	0,0
Hisamitsu Pharmaceutical	17 500	4 930	0,0	Nomura Real Estate Master Fund	520	6 455	0,0
Hitachi	131 152	87 191	0,1	Nomura Research Institute	47 267	13 992	0,0
Hitachi Construction Machines	36 170	10 888	0,0	NSK	104 000	7 130	0,0
Honda	132 120	42 861	0,0	NTT Data Group	70 360	10 553	0,0
Hoshizaki Electric	23 300	8 978	0,0	Obayashi	85 900	7 986	0,0
Hoya	52 027	66 388	0,1	Obic Co	4 900	8 437	0,0
Huic	116 000	10 671	0,0	Odakyu Electric Railway	94 300	13 569	0,0
Ibiden	26 000	15 738	0,0	Oji Holdings	116 200	4 668	0,0
IHI	11 400	3 312	0,0	Olympus	183 900	31 142	0,0
Iida Group Holdings	33 732	6 116	0,0	Omron	28 563	18 716	0,0
Isetan Mitsukoshi Holdings	26 400	2 884	0,0	ONO Pharmaceutical	86 200	16 787	0,0
Isuzu Motors	29 667	3 858	0,0	Open House Group	26 000	10 040	0,0
Ito En	21 400	6 347	0,0	Oracle Japan	2 400	1 917	0,0
Itochu Techno-Science	3 200	870	0,0	Oriental Land	108 500	45 415	0,1
J. Front Retailing	153 800	15 844	0,0	Orix	145 940	28 493	0,0
Japan Airlines	30 270	7 058	0,0	Orix Jreit REIT	560	7 424	0,0
Japan Exchange Group	47 800	8 959	0,0	Otsuka Holdings	55 657	21 924	0,0
Japan Post Bank	42 200	3 545	0,0	Otsuka Pharmaceutical	13 700	5 720	0,0
Japan Post Insurance	30 800	4 987	0,0	Panasonic Holdings	313 979	41 144	0,0
Japan Retail Fund Investment	1 118	8 046	0,0	Park24	279 200	40 728	0,0
JS Group	34 084	4 646	0,0	Persol Holdings	16 000	3 096	0,0
JSR	36 848	11 318	0,0	Pola Orbis	41 695	6 528	0,0
Jtekt	43 000	4 194	0,0	Rakus	4 100	744	0,0
Kajima	76 500	12 406	0,0	Rakuten Group	144 624	5 393	0,0
Kakaku.com	11 144	1 718	0,0	Recruit Holdings	180 100	61 414	0,1
Kansai Paint	27 500	4 346	0,0	Renesas Electronics	163 400	32 988	0,0
Kao	55 187	21 504	0,0	Resona Holdings	264 780	13 659	0,0
Kawasaki Kisen	27 700	7 285	0,0	Resonac Holdings	3 500	608	0,0
KDDI	192 310	63 954	0,1	Ricoh	192 700	17 605	0,0
Keihan Electric Railway	30 300	8 586	0,0	Rinnai	12 300	2 878	0,0
Keikyu	90 100	8 565	0,0	Rohm	12 708	12 840	0,0
Keio Electric Railway	37 199	12 574	0,0	Ryohin Keikaku	46 960	4 992	0,0
Keisei Electric Railway	53 700	23 902	0,0	Santen Pharmaceutical	63 800	5 843	0,0
Kewpie	31 500	5 546	0,0	SBI Holdings	17 100	3 538	0,0
Keyence	27 696	140 433	0,2	SCSK	17 400	2 938	0,0
Kikkoman	20 500	12 550	0,0	Secom	20 987	15 275	0,0
Kintetsu	45 600	16 984	0,0	Seibu Holdings	117 800	13 047	0,0
Kobayashi Pharmaceutical	14 600	8 533	0,0	Seiko Epson	58 600	9 805	0,0
Kobe Bussan	41 900	11 667	0,0	Sekisui Chemical	67 094	10 389	0,0
Koito Manufacturing	55 128	10 681	0,0	Sekisui House	95 350	20 704	0,0
Komatsu	134 900	39 125	0,0	Seven Bank	24 900	527	0,0
Konami Group	18 100	10 173	0,0	SG Holdings	151 000	23 105	0,0
Kose	20 000	20 611	0,0	Sharp	46 199	2 775	0,0
Kubota	244 001	38 274	0,0	Shimadzu	44 800	14 825	0,0
Kuraray	71 217	7 443	0,0	Shimamura	4 400	4 479	0,0
Kyocera	62 464	36 369	0,0	Shimano	21 745	38 936	0,0
Kyowa Hakko Kirin	61 800	12 303	0,0	Shimizu	150 800	10 259	0,0
Kyushu Railway	45 000	10 415	0,0	Shin-Etsu Chemical	278 360	99 185	0,1
Lasertec	29 900	48 209	0,1	Shionogi	48 270	21 896	0,0
Lion	47 900	4 806	0,0	Shiseido	52 100	25 281	0,0
M3	29 418	6 835	0,0	Shizuoka Financial Group	38 993	3 028	0,0
Makita	41 996	12 667	0,0	SMC	8 704	51 699	0,1



Handelsbanken Global Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusenl	Marknads- värde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusenl	Marknads- värde ISEK	% av fondförm.
Softbank	265 100	30 509	0,0	Progressive Waste Solutions CAD	30 392	46 969	0,1
SoftBank	114 528	57 969	0,1	Progressive Waste Solutions USD	8 895	13 732	0,0
Sohgo Security Services	25 500	1 552	0,0	Quebecor B	20 800	5 543	0,0
Sony Group	209 270	202 760	0,2	RB Globa	86 446	56 098	0,1
Square Enix Holdings	4 900	2 449	0,0	Restaurant Brands International	41 106	34 463	0,0
Stanley Electric	28 100	6 092	0,0	RioCan Real Estate Investment Trust	224 428	35 320	0,0
Start Today	25 700	5 706	0,0	Rogers Communications	42 734	21 083	0,0
Sugi Pharmacy	16 700	8 012	0,0	Royal Bank of Canada	199 842	206 386	0,2
Sumco	51 200	7 760	0,0	Saputo	24 490	5 933	0,0
Sumitomo Electric Industries	105 534	13 857	0,0	Shopify A	207 554	145 058	0,2
Sumitomo Heavy Industries	19 800	5 087	0,0	Sun Life Financial	72 319	40 767	0,0
Sumitomo Metal Mining	41 082	14 218	0,0	Telus non-Canadian	61 337	12 907	0,0
Sumitomo Mitsui Financial Group	161 565	74 364	0,1	TFI International	22 888	28 198	0,0
Sumitomo Mitsui Trust Holdings	30 471	11 643	0,0	Thomson Reuters	23 884	34 870	0,0
Sumitomo Pharma	24 900	1 189	0,0	Toronto-Dominion Bank	260 225	174 413	0,2
Sumitomo Realty & Development	62 500	16 595	0,0	Wheaton Precious Metals	93 693	43 815	0,1
Sumitomo Rubber Industries	30 800	3 209	0,0	WSP Global	20 400	29 144	0,0
Sundrug	19 700	6 283	0,0			<b>2 412 603</b>	<b>2,8</b>
Suntory Beverage & Food	35 675	13 895	0,0	KINA			
Suzuki	20 697	8 044	0,0	360 Security Technology A	62 000	1 156	0,0
Systemex	59 900	43 878	0,1	37 Interactive Entertainment	31 800	1 649	0,0
T&D Holdings	58 050	9 134	0,0	Agricultural Bank of China	2 823 832	11 988	0,0
Taisei	40 300	15 122	0,0	Air China	150 000	1 154	0,0
Taisho Pharmaceutical	17 300	7 002	0,0	Akeso	11 000	536	0,0
Taiyo Yuden	32 300	9 865	0,0	Alibaba Group Holding	2 621 100	293 351	0,3
Takeda Pharmaceutical	210 391	71 177	0,1	Amperex Tech A	12 100	4 116	0,0
TBS Holdings	3 700	725	0,0	Angang New Steel	29 800	84	0,0
TDK	45 300	18 846	0,0	Angel Yeast A	134 600	7 247	0,0
Terumo	86 928	29 636	0,0	Anta Sports	184 000	20 301	0,0
THK	25 200	5 546	0,0	Asymchem Laboratories A	33 800	5 924	0,0
Tis	28 900	7 756	0,0	Asymchem Laboratories H	31 740	3 845	0,0
Tobu Railway	59 500	17 155	0,0	Autohome	47 335	14 909	0,0
Toho	15 200	6 215	0,0	Baidu ADR	36 061	53 327	0,1
Tokio Marine Holdings	212 328	52 601	0,1	Bank of China	9 542 659	41 300	0,0
Tokyo Electron	63 294	97 250	0,1	Bank of Communications	1 591 331	11 384	0,0
Tokyu	140 800	18 251	0,0	Betta Pharma A	54 000	3 857	0,0
Tokyu Fudosan	180 600	11 110	0,0	BGI Genomics A	38 500	3 434	0,0
Toppan	49 100	11 375	0,0	By-Health A	265 000	9 449	0,0
Toray Industries	195 200	11 676	0,0	BYD	136 562	47 056	0,1
Toshiba	52 200	17 621	0,0	BYD A	3 800	1 459	0,0
Tosoh	51 500	6 539	0,0	BYD Electronic	147 000	4 802	0,0
Toto	18 600	6 012	0,0	CanSino Biologics	13 600	490	0,0
Toyo Suisan Kaisha	27 300	13 267	0,0	Changchun High & New Technology Industry	16 300	3 304	0,0
Toyota Industries	19 246	14 750	0,0	Changzhou Xingyu Automotive A	19 000	3 492	0,0
Toyota Motor	1 630 100	281 221	0,3	Chaozhou Three A	202 000	8 816	0,0
Toyota Tsusho	50 300	26 835	0,0	Chengxin Lithium Group A	135 400	6 416	0,0
Trend Micro	9 200	4 775	0,0	China Cinda Asset Management	129 000	139	0,0
Tsuruha Holdings	12 800	10 240	0,0	China Citic Bank	1 284 279	6 514	0,0
Unicharm	60 277	24 059	0,0	China Conch Venture	291 500	4 098	0,0
United Urban Investment REIT	277	3 010	0,0	China Construction Bank	10 208 611	71 338	0,1
USS	104 300	18 535	0,0	China Cosco Holdings	163 200	1 588	0,0
Welcia Holdings	34 300	7 678	0,0	China Energy Engineering H	2 456 000	3 250	0,0
West Japan Railways	38 300	17 145	0,0	China Everbright Bank H	3 049 103	9 456	0,0
Workman	7 500	2 915	0,0	China Feihe	507 000	3 047	0,0
Yakult Honsha	31 400	21 365	0,0	China Galaxy Securities H	394 600	2 273	0,0
Yamada Holdings	68 510	2 173	0,0	China International Capital H	23 200	439	0,0
Yamaha	37 451	15 410	0,0	China Jushi A	198 400	4 177	0,0
Yamaha Motor	30 143	9 285	0,0	China Life Insurance HKD	467 319	8 412	0,0
Yamato Holdings	58 392	11 359	0,0	China Literature	19 600	890	0,0
Yamazaki Baking	20 000	2 916	0,0	China Merch Shekou A	428 100	8 294	0,0
Yaskawa Electric	24 900	12 250	0,0	China Merchants Bank	520 200	25 525	0,0
Yokogawa Electric	66 900	13 251	0,0	China Minmetals Rare Earth A	136 800	6 021	0,0
Yokohama Rubber	6 700	1 577	0,0	China Minsheng Banking	3 342 356	13 360	0,0
Z Holdings	337 900	8 747	0,0	China Molybdenum	1 734 000	9 799	0,0
		<b>5 446 559</b>	<b>6,3</b>	China National Nuclear Power A	422 600	4 430	0,0
KANADA				China Pacific Insurance	335 080	9 352	0,0
Agnico-Eagle Mines	98 149	52 997	0,1	China Railway Group	2 357 966	16 803	0,0
Air Canada	71 238	14 532	0,0	China Resources Mixc Lifestyle Services	139 400	7 474	0,0
B2Gold	186 515	7 186	0,0	China Southern Airlines	146 000	889	0,0
Bank of Montreal	98 244	95 944	0,1	China Three Gorges A	1 481 300	11 828	0,0
Bank of Nova Scotia	169 014	91 441	0,1	China Tower H	5 836 000	6 998	0,0
BCE	136 842	67 467	0,1	China Vanke H	1 443 900	20 936	0,0
Cameco	96 755	32 768	0,0	Chongqing Changan Automobile A	46 800	900	0,0
Can Apartment Prop Real Esta	50 939	21 148	0,0	Chongqing Rural	781 000	2 982	0,0
Canadian Imperial Bank of Commerce	69 807	32 229	0,0	Citic Securities H	461 735	9 037	0,0
Canadian National Railway	103 075	134 973	0,2	Country Garden Holdings	956 000	2 095	0,0
Canadian Pacific Kansas City	175 235	153 052	0,2	Country Garden Services Holding	261 000	3 641	0,0
CCL Industries B	48 419	25 737	0,0	Cq Zhifei Biolo A	79 800	5 245	0,0
CGI	31 710	36 160	0,0	CSC Financial H	207 000	2 305	0,0
Choice Properties Real Estate Investment Units	308 525	34 175	0,0	CSPC Pharmaceutical Group	1 644 240	15 433	0,0
Constellation Software	2 505	56 124	0,1	Dali Foods Group	2 197 000	10 599	0,0
Dollarama	77 281	56 597	0,1	DFZQ H	246 800	1 459	0,0
Fairfax Financial Holdings	2 300	18 629	0,0	Dongfeng Motor	574 000	2 832	0,0
Gildan Activewear	51 738	18 037	0,0	East Money Info A	330 600	6 981	0,0
GM Financial	32 000	10 534	0,0	Ecovacs Robotics A	87 500	10 119	0,0
Great-West Lifeco	33 700	10 582	0,0	EVE Energy A	68 700	6 180	0,0
Hydro One	106 700	32 966	0,0	Everbright Securities A	100 300	2 370	0,0
iA Financial	25 753	18 972	0,0	Flat Glass Group A	28 700	1 643	0,0
Intact Financial	8 700	14 526	0,0	Flat Glass Group H	123 000	4 535	0,0
Ivanhoe Mines A	497 710	49 158	0,1	Focus Media A	682 300	6 909	0,0
Kinross Gold	144 397	7 449	0,0	Foshan Hai Tian Flavouring & Food A	111 840	7 791	0,0
Lululemon Athletica	27 574	112 731	0,1	Fosun International	134 000	994	0,0
Lundin Mining	25 000	2 118	0,0	Foxconn Industrial Internet A	255 500	9 574	0,0
Magna International	55 001	33 577	0,0	Future Land Holdings	245 500	5 260	0,0
Manulife Financial	206 173	42 141	0,0	Fuyao Glass Industry Group	18 000	804	0,0
Metro	54 209	33 107	0,0	Ganfeng Lithium Group A	16 400	1 487	0,0
National Bank of Canada	56 694	45 676	0,1	Ganfeng Lithium Group H	79 999	5 634	0,0
Nutrien	87 527	55 878	0,1	Gemdale A	274 300	2 941	0,0
Onex	17 500	10 452	0,0	Genscript Biotech	198 000	4 803	0,0
OpenText	39 608	17 814	0,0	GF Securities	598 860	8 931	0,0
Pan American Silver	51 049	8 042	0,0	GoerTek A	117 300	3 096	0,0
Power Corporation of Canada	78 963	22 985	0,0	Goldwind H	514 480	3 808	0,0

Handelsbanken Global Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
Gotion High-tech A	98 400	4 041	0,0	Sz Inovance Tec A	76 000	7 256	0,0
Great Wall Motor	303 500	3 752	0,0	Sz Mindray Bio-Medical Electronics A	21 900	9 763	0,0
Guangdong Kinlong Hardware	39 700	3 820	0,0	TCL Technology A	691 300	4 050	0,0
Guangzhou Automobile Group	840 399	5 409	0,0	TCL Zhonghuan Renewable Energy Tech	180 000	8 886	0,0
Guangzhou Pharmaceutical	300 000	9 779	0,0	Tencent	902 308	412 399	0,5
Guangzhou Shiyuan Electronic Technology	26 400	2 624	0,0	Tencent Music ADR	67 200	5 357	0,0
Guangzhou Tinci Materials	111 200	6 811	0,0	Tingyi Holdings	496 000	8 327	0,0
Guotai Junan Securities H	725 000	9 183	0,0	Toly Bread A	122 400	1 842	0,0
H World Group ADR	4 000	1 675	0,0	Tongkun Group A	94 300	1 858	0,0
Haidilao International Holding	19 000	451	0,0	Topchoice Medical A	26 500	3 817	0,0
Haier Smart Home H	1 991 209	67 652	0,1	TravelSky Technology	92 000	1 687	0,0
Haitong Securities	2 081 577	13 772	0,0	Trina Solar A	86 909	5 506	0,0
Han's Laser Technology A	180 800	7 044	0,0	Trip.com Group ADR	73 405	27 750	0,0
Hangzhou First Applied Material A	146 020	8 075	0,0	Uni-President China	654 000	5 949	0,0
Hansoh Pharma	644 000	11 184	0,0	Unisplendour A	80 500	3 812	0,0
Hengan International	368 000	16 738	0,0	Vipshop ADR	215 666	38 436	0,0
Hengrui Medic A	150 300	10 705	0,0	Walvax Biotech A	78 400	3 083	0,0
Hengyi Petrochemical A	326 500	3 292	0,0	Wanhua Chemical A	55 100	7 197	0,0
Hua Hong Semiconductor	26 000	917	0,0	Want Want China Holdings	2 062 772	14 784	0,0
Huadong Medicine A	104 600	6 746	0,0	Weibo A	3 860	547	0,0
Huaneng Lancang River Hydropower A	640 900	6 795	0,0	Weichai Power	1 511 000	23 909	0,0
Huatai Securities	920 100	12 276	0,0	Wens Foodstuff A	202 100	5 514	0,0
Huaxi Securities A	165 200	2 041	0,0	Will Semiconductor Shanghai A	86 300	12 581	0,0
Hygeia Healthc Rg	14 400	842	0,0	Wingtech Technology A	65 400	4 755	0,0
HZ Tigermed C-H	29 700	1 828	0,0	WUS Printed Circuit (Kunshan) A	295 400	9 198	0,0
Imeik Technology Development A	10 000	6 616	0,0	WuXi AppTec	43 862	3 778	0,0
Industrial & Commercial Bank of China HKD	11 245 405	64 789	0,1	Wuxi Aptec A	122 800	11 378	0,0
Inner Mongolia A	107 200	4 514	0,0	Wuxi Biologics	563 000	29 138	0,0
Innovent Bio	94 000	3 835	0,0	Wuxi Lead Intelligent Equipment	88 800	4 776	0,0
Inspur Electronic Information Industry	3 600	260	0,0	Xiaomi	1 980 800	29 267	0,0
JA Solar Technology A	91 100	5 649	0,0	Xinyi Solar Holdings	782 000	9 754	0,0
Jafron Biomedical A	152 200	5 246	0,0	Xpeng A	164 300	11 323	0,0
JD Health International	10 550	719	0,0	Yangzijiang Shipbuilding	318 722	3 816	0,0
JD.com ADR	186 063	68 592	0,1	Yealink Network Technology A	190 980	9 959	0,0
Jiangsu Eastern Shenghong A	434 300	7 633	0,0	Yifeng Pharmacy Chain A	63 680	3 503	0,0
Joinn Laboratories China H	84 839	2 304	0,0	Yihai Kerry Arawana Holdings A	123 200	7 326	0,0
Jonjee Hi-Tech Indust and Commercial	159 900	8 747	0,0	Yunnan Baiyao A	131 400	10 254	0,0
Juwei Food A	52 100	2 878	0,0	Yunnan Energy New Material A	48 900	7 006	0,0
KE Holdings	53 885	8 643	0,0	Zai Lab Unsp ADR	55 585	16 649	0,0
Kingdee International Software Group	58 000	838	0,0	Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical	21 300	9 070	0,0
Kuaishou Technology Prep	115 400	8 518	0,0	Zhejiang Century Huatong A	266 100	3 003	0,0
Kuang-Chi Technologies A	284 800	6 462	0,0	Zhejiang Chint Electrics A	99 900	4 107	0,0
Lenovo Group HKD	1 463 589	16 481	0,0	Zhejiang Expressway	1 398 000	11 465	0,0
Lepu Medical Technology Beijing A	62 700	2 108	0,0	Zhejiang Huahai A	149 400	4 090	0,0
Li Ning	403 500	23 442	0,0	Zhejiang Huayou Cobalt A	72 700	4 963	0,0
Lingyi Itech (Gua Agdong) A	54 900	564	0,0	Zhejiang NHU A	152 300	3 488	0,0
Longfor Properties	603 500	15 838	0,0	Zhongji Innoli A	18 700	4 100	0,0
LONGi Green Energy Technology A	208 600	8 893	0,0	Zhongsheng Group	97 000	4 004	0,0
Luxshare Precision Industry A	65 700	3 170	0,0	Zhuzhou CSR Times Electric	27 610	1 111	0,0
Mango Excellent Media A	23 000	1 170	0,0	Zj Dingli Machi A	35 800	2 982	0,0
Meinian Onehealth Healthcare Holdings	331 800	3 508	0,0	Zoomlion	261 200	1 458	0,0
Meituan B	858 670	144 744	0,2	ZTE H	364 400	15 771	0,0
Microport Scientific	93 200	1 819	0,0	ZTO Express Cayman ADR	121 984	33 045	0,0
Ming Yang Smar A	144 800	3 634	0,0			<b>2 879 575</b>	<b>3,3</b>
Muyuan Foods A	146 400	9 176	0,0	<b>LUXEMBURG</b>			
Naura Technology Group	36 100	17 051	0,0	Allegro.eu	237 971	20 245	0,0
NavInfo A	280 900	4 837	0,0	B&M European Value Retail	409 184	31 298	0,0
NetEase	194 400	40 888	0,0	Eurofins Scientific	12 210	8 368	0,0
New China Life Insurance H	52 000	1 480	0,0	Spotify Technology	15 916	27 601	0,0
Ninestar A	160 100	8 154	0,0			<b>87 512</b>	<b>0,1</b>
NIO ADR 1 A	293 805	30 751	0,0	<b>MALAYSIA</b>			
Nongfu Spring H	352 200	20 995	0,0	AmBank Group	465 000	3 895	0,0
Oppen Home GroupA	31 700	4 516	0,0	Axiata	320 100	1 963	0,0
Ovctek China A	129 600	5 818	0,0	Celcomdigi	346 100	3 292	0,0
People's Insurance Company of China HKD	1 648 000	6 451	0,0	CIMB	644 100	7 542	0,0
Perfect World A	37 000	929	0,0	Hong Leong Bank	145 100	6 366	0,0
Pharmaron Beijing A	70 800	4 030	0,0	IHH Healthcare	489 700	6 675	0,0
PICC Property and Casualty	407 000	4 886	0,0	Inari Amertron	1 096 900	6 955	0,0
Ping An Insurance	508 768	34 957	0,0	IOI	144 500	1 247	0,0
Poly Property Development H	105 000	5 492	0,0	Kuala Lumpur Kepong	217 293	11 043	0,0
Pop Mart Intl	51 400	1 234	0,0	Lynas Rare Earths	673 000	33 146	0,0
Postals Savings Bank of China	1 637 000	10 875	0,0	Malayan Banking	389 900	7 787	0,0
Rongsheng Petro Chemical A	249 700	4 322	0,0	Malaysia Airports	1 475 900	23 498	0,0
S.F. Holding A	21 300	1 428	0,0	Maxis	207 400	1 968	0,0
Sany Heavy Industry A	126 800	3 136	0,0	Nestle Malaysia	31 000	9 398	0,0
Shandong Dong E E Jiao A	31 700	2 519	0,0	Petronas Chemicals Group	910 900	12 648	0,0
Shandong Gold Mining H	443 700	8 733	0,0	PPB Group	243 280	8 861	0,0
Shandong Linglong Tyre A	23 000	760	0,0	Press Metal Aluminium Holding	618 400	6 726	0,0
Shandong Weigao Group	402 800	5 685	0,0	Public Bank	1 342 370	11 960	0,0
Shanghai Electric Group	4 242 000	10 700	0,0	QL Resources	404 200	5 014	0,0
Shanghai Fosun Pharmaceutical	256 500	7 389	0,0	RHB Capital	189 591	2 382	0,0
Shanghai Fosun Pharmaceutical A	43 700	2 008	0,0	Sime Darby	1 103 300	5 234	0,0
Shanghai International Airport	65 800	4 444	0,0	Sime Darby Plantation	575 000	5 522	0,0
Shanghai Junshi Biosciences H	59 400	1 867	0,0	Telekom Malaysia	126 400	1 436	0,0
Shanghai M&G Stationery A	36 500	2 423	0,0			<b>184 559</b>	<b>0,2</b>
Shanghai Pharmaceuticals Holding	294 100	6 291	0,0	<b>MEXIKO</b>			
Shanghai Putailai A	133 000	7 559	0,0	Alfa	1 781 300	11 948	0,0
Shanghai Yuyuan Tourist Mart A	208 800	2 130	0,0	America Movil	3 262 705	38 220	0,0
Shanxi Taigang Stainless Steel A	415 400	2 390	0,0	Arca Continental	211 673	23 455	0,0
Shengyi Technology A	295 000	6 229	0,0	Banorte	349 285	31 063	0,0
Shenzhen Dynanonic A	30 080	4 930	0,0	Cemex	1 347 349	10 268	0,0
Shenzhen Overseas Chinese Town A	1 125 200	7 362	0,0	Controladora Axtel	1 781 300	249	0,0
Shenzhou International Group Holdings	96 534	9 946	0,0	El Puerto de Liverpool	217 100	14 262	0,0
Sichuan Chuantou Energy A	167 000	3 737	0,0	Fibra Uno Administracion	238 800	3 760	0,0
Sinopharm Group	322 619	10 894	0,0	Fresnillo	99 262	8 318	0,0
Sinotrans HKD	1 566 000	6 022	0,0	Gruma	90 745	15 704	0,0
Sinotruk Hong Kong	24 500	514	0,0	Grupo Aeroportuario del Pacifico	143 322	27 732	0,0
Skshu Paint	54 600	5 311	0,0	Grupo Aeroportuario del Sureste	74 233	22 310	0,0
Sungrow Power Supply A	34 600	6 000	0,0	Grupo Bimbo	403 179	23 272	0,0
Sunny Optical Technology Group	101 100	10 890	0,0	Grupo Carso Series A1	372 500	29 170	0,0
Sunwoda Elec A	172 400	4 184	0,0	Grupo Electra	9 040	6 588	0,0
Suzhou Maxwell Technologies A	26 880	6 770	0,0				







Handelsbanken Global Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
Ally Financial	44 675	13 034	0,0	Ebay	204 831	98 874	0,1
Alnylam Pharmaceuticals	34 794	71 383	0,1	Ecolab	68 637	138 406	0,2
Alphabet A	911 287	1 178 217	1,4	Edison International	61 547	46 169	0,1
Alphabet C	792 176	1 035 084	1,2	Edwards LifeSciences	89 173	90 857	0,1
Amdocs	18 157	19 386	0,0	Electronic Arts	34 165	47 863	0,1
American Express	78 348	147 419	0,2	Elevance Health	34 064	163 470	0,2
American Tower	71 847	150 505	0,2	Eli Lilly	138 909	703 657	0,8
American Water Works	31 458	48 505	0,1	Emerson Electric	92 675	90 481	0,1
Ameriprise Financial	15 122	54 254	0,1	Enphase Energy	23 472	42 461	0,0
AmerisourceBergen	33 551	69 736	0,1	EPAM Systems	6 849	16 627	0,0
Amgen	78 977	189 395	0,2	Equifax	15 017	38 166	0,0
Analog Devices	73 686	155 050	0,2	Equinix REIT	12 205	103 347	0,1
Ansys	11 344	40 468	0,0	Equity Residential	73 328	52 251	0,1
Apollo Asset Management A	29 702	24 642	0,0	Essex Property Trust	12 442	31 488	0,0
Apple	2 157 343	4 519 910	5,2	Estee Lauder CL A	58 086	123 210	0,1
Applied Material	127 576	199 174	0,2	Etsy	39 905	36 469	0,0
Archer Daniels Midland	79 910	65 218	0,1	Expedia	8 743	10 330	0,0
Arista Networks	45 793	80 159	0,1	Expeditors International	36 021	47 128	0,1
Arthur J Gallaghe	13 094	31 054	0,0	Extra Space Storage	20 592	33 107	0,0
AT&T	988 019	170 217	0,2	Fair Isaac	1 069	9 344	0,0
Atlassian A	21 055	38 164	0,0	Fastenal	129 795	82 701	0,1
Autodesk	29 247	64 637	0,1	FedEx	38 783	103 847	0,1
Automatic Data Processing	57 035	135 402	0,2	Fidelity National Financia	48 082	18 697	0,0
AutoZone	4 311	116 102	0,1	Fidelity National Information Services	96 699	57 133	0,1
AvalonBay Communities	24 525	50 138	0,1	Fifth Third Bancorp	101 999	28 876	0,0
Ball	49 744	31 276	0,0	Fiserv	81 665	111 275	0,1
Bank of America	1 008 964	312 667	0,4	FleetCor Technologies	11 980	32 490	0,0
Bank of New York Mellon	115 970	55 767	0,1	FMC	42 074	47 418	0,1
Baxter International	64 729	31 854	0,0	Ford	517 730	84 609	0,1
Becton Dickinson	40 691	116 037	0,1	Fortinet	85 853	70 096	0,1
BeiGene ADR	17 809	34 298	0,0	Fox A	40 255	14 783	0,0
Best Buy	32 834	29 064	0,0	Fox B	17 071	5 880	0,0
Biogen	23 390	71 965	0,1	Franklin Resources	57 109	16 476	0,0
Biomarin Pharmaceutical	40 230	37 666	0,0	Freepport McMoRan	305 121	131 828	0,2
BlackRock	17 964	134 105	0,2	Gartner	10 576	40 018	0,0
Blackstone	90 484	90 864	0,1	GE HealthCare Technologies	51 118	44 856	0,1
Block	65 444	47 057	0,1	Gen Digital	73 921	14 811	0,0
Booking Holding	5 433	158 465	0,2	General Mills	88 631	73 427	0,1
Boston Scientific	227 868	133 130	0,2	General Motors	189 443	78 903	0,1
Bristol-Myers Squibb	328 143	226 663	0,3	Genuine Parts	28 561	52 207	0,1
Broadcom	66 360	621 752	0,7	Gilead Science	203 052	169 032	0,2
Broadridge Financial Solutions	21 197	37 922	0,0	Global Payments	32 306	34 378	0,0
Burlington Stores	11 000	18 700	0,0	Globe Life N	19 930	23 598	0,0
C.H. Robinson Worldwide	33 042	33 673	0,0	Goldman Sachs	43 237	150 631	0,2
Cadence Design Systems	33 075	83 783	0,1	Hartford Financial Services Group	38 135	29 666	0,0
Campbell Soup	33 291	16 437	0,0	Hasbro	23 373	16 352	0,0
Cap One Finance	53 864	63 632	0,1	HCA Holdings	29 870	97 913	0,1
Cardinal Health	55 417	56 607	0,1	Healthpeak Properties	117 107	25 425	0,0
CarMax	24 542	22 188	0,0	Henry Schein	36 683	32 134	0,0
Carnival Paired CTF	387 733	78 860	0,1	Hershey	25 547	68 902	0,1
Carrier Global	136 057	73 053	0,1	Hewlett-Packard	185 726	61 607	0,1
Caterpillar	63 796	169 548	0,2	Hewlett-Packard Enterprise	235 132	42 667	0,0
Cboe Holdings	18 978	28 266	0,0	Hilton Worldwide Holdings	36 091	56 740	0,1
Cbre Group	41 287	35 993	0,0	Hologic	47 192	41 273	0,0
CDW	3 578	7 092	0,0	Home Depot	147 120	493 634	0,6
Centene	63 013	45 908	0,1	Hormel Foods	56 110	24 376	0,0
Charles Schwab	198 820	121 721	0,1	HubSpot	5 027	28 891	0,0
Charter Communications	10 524	41 760	0,0	Humana	18 342	88 584	0,1
Chewy A	27 502	11 725	0,0	Huntington Bancshares	223 054	25 972	0,0
Chipotle Mexican Grill	3 771	87 125	0,1	IBM	114 913	166 086	0,2
Church & Dwight	66 799	72 318	0,1	Idexx Laboratories	10 764	58 392	0,1
Cincinnati Financial	24 935	26 211	0,0	Illinois Tool Works	49 179	132 884	0,2
Cintas	12 749	68 451	0,1	illumina	31 311	63 409	0,1
Cisco Systems	598 508	334 482	0,4	Incyte	66 832	44 937	0,1
Citigroup	290 572	144 499	0,2	Ingersoll Rand	93 309	65 874	0,1
Citizens Financial Group	65 899	18 564	0,0	Intel	614 994	222 133	0,3
Clorox	19 555	33 592	0,0	Interactive Brokers Group A	24 250	21 759	0,0
Cloudfare A	44 231	31 231	0,0	Intercontinental Exchange	73 286	89 512	0,1
CME Group	52 573	105 218	0,1	International Flavors & Fragrances	34 450	29 616	0,0
Coca-Cola	547 849	356 351	0,4	International Paper	58 021	19 935	0,0
Cognizant Technology Solutions	70 012	49 366	0,1	Intuit	37 707	186 614	0,2
Colgate-Palmolive	122 992	102 346	0,1	Intuitive Surgical	62 963	232 547	0,3
Comcast A	564 985	253 562	0,3	Invitation Homes	109 143	40 554	0,0
Conagra	91 805	33 437	0,0	IQVIA Holdings	26 153	63 494	0,1
Cooper	9 770	40 463	0,0	Iron Mountain	93 117	57 149	0,1
Copart	63 400	62 461	0,1	J.B. Hunt Transport Services	21 105	41 268	0,0
Corning	321 850	121 813	0,1	J.M. Smucker	20 462	32 637	0,0
Corteva	141 764	87 740	0,1	Johnson & Johnson	406 152	726 131	0,8
CoStar Group	86 909	83 547	0,1	JPMorgan Chase & Co	435 347	683 904	0,8
Coupanq A	266 139	50 019	0,1	Kellogg's	41 857	30 472	0,0
CrowdStrike Holdings	35 095	55 674	0,1	Keurig Dr Pepper	136 858	46 225	0,1
Crown Castle	89 807	110 525	0,1	Keycorp	139 231	13 896	0,0
CSX	369 783	136 200	0,2	Keysight Technologies	28 925	52 316	0,1
Cummins	19 507	51 655	0,1	Kimberly-Clark	45 716	68 173	0,1
CVS Health	207 232	154 739	0,2	KKR & Co	61 853	37 413	0,0
D. R. Horton	56 665	74 481	0,1	KLA-Tencor	22 176	116 177	0,1
Danaher	119 147	308 866	0,4	Kraft Heinz	113 919	43 682	0,1
Datadog A	29 952	31 828	0,0	Laboratory Corporation of America	13 386	34 893	0,0
Deere & Company	38 452	168 288	0,2	LAM Research	20 379	141 506	0,2
DELL Technologies C	93 486	54 639	0,1	Lennar A	45 708	61 866	0,1
Delta Air Lines	114 978	59 040	0,1	Lennar B	15 555	18 982	0,0
DexCom	87 697	121 730	0,1	Liberty Broadband A	800	689	0,0
Digital Realty Trust	44 977	55 319	0,1	Liberty Broadband C	15 300	13 239	0,0
Discover Financial Services	35 167	44 385	0,1	LKQ	134 776	84 827	0,1
DocuSign	22 173	12 236	0,0	Lowe's	91 981	224 236	0,3
Dollar General	36 726	67 350	0,1	M&T Bank	21 757	29 084	0,0
Dollar Tree	49 161	76 199	0,1	Market Group	2 100	31 374	0,0
Domino's Pizza	4 081	14 855	0,0	Marriott International	38 422	76 233	0,1
DoorDash A	19 247	15 887	0,0	Marsh & McLennan	66 402	134 896	0,2
Dover	31 860	50 811	0,1	Martin Marietta Materials	11 304	56 371	0,1
Dow	50 797	29 222	0,0	Marvell Technology	135 850	87 719	0,1
DuPont de Nemours	97 613	75 323	0,1	Masco	45 445	28 166	0,0



Handelsbanken Global Index Criteria, forts.

Övriga finansiella instrument			0,0
	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>ONOTERADE AKTIER</b>			
KANADA			
Thomson Reuters	1	1	0,0
		<b>1</b>	<b>0,0</b>
STORBRIANNIEN			
NMC Health	29 800	0	0,0
		<b>0</b>	<b>0,0</b>
TAIWAN			
Acer R	439	3	0,0
		<b>3</b>	<b>0,0</b>
<b>Onoterade aktier</b>		<b>4</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>85 577 799</b>	<b>99,3</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		581 823	0,7
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>86 159 621</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

### Sammanställning, företags- och koncernexponeringar\*

Företag/koncern	% av fondförmögenheten	Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Alphabet	2,6	Unilever PLC	0,2
Samsung	0,6	Colgate-Palmolive	0,1
Roche Holding	0,4	Atlas Copco	0,1
Toyota Group	0,4	Prudential	0,1
AstraZeneca PLC	0,4		

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehåller mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

### Uppgifter om fondens värdepapperslån

**Volym utlånade värdepapper, tSEK** **3 051 959**

**Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar** **3,6**

### De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:

Amerikanska staten	1 478 186
Brittiska staten	236 292
Franska staten	122 507
Nvidia	21 634
Tyska staten	21 323
Seven & I Holdings	20 963
Genuine Parts	18 505
Starbucks	18 262
Rio Tinto	17 913
Liberty Broadband	17 874

### De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:

Goldman Sachs International	657 097
Barclays Bank	521 526
UBS AG London Branch	508 221
BNP Paribas Arbitrage SNC	346 543
Citigroup Global Markets	294 938
Barclays Capital Securities	283 885
J.P. Morgan Securities	187 236
Morgan Stanley & Co. International	144 172
Merrill Lynch International	136 549
HSBC Bank	128 671

### Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:

Aktier	1 451 323
Obligationer och andra räntebärande instrument	1 888 979
	<b>3 340 302</b>

Vi godtar statsobligationer och statskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

### Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	2 323
En till tre månader	2 711
Tre månader till ett år	108 646
Mer än ett år	1 775 299
Obestämd löptid	1 451 323
	<b>3 340 302</b>

### Motparternas hemvist, tSEK

Frankrike	346 543
Storbritannien	2 862 295
Sverige	131 464
	<b>3 340 302</b>

### Säkerheternas valuta, tSEK

AUD	8 486
CHF	30 858
DKK	6 724
EUR	199 566
GBP	388 809
HKD	59 501
JPY	400 939
NZD	568
SEK	8 029
SGD	5 514
USD	2 231 309
	<b>3 340 302</b>

### Avveckling och clearing, tSEK

Tredje part	3 340 302
	<b>3 340 302</b>

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

### Uppgifter om avkastning och kostnad:

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 8 139 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

### Motparter för värdepappersutlåning under året:

- Barclays Bank
- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- Credit Suisse International
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- SEB
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende sponsrad, garanterad, godkänd, emitterad, marknadsförd, såld eller understödd på något annat sätt av Solactive AG (Solactive) och Solactive lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av dess index, index varumärke eller indexnivå kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. Indexet beräknas och publiceras av Solactive. Solactive gör sitt bästa för att se till att indexet beräknas korrekt. Oavsett skyldigheter gentemot fondens emittent har Solactive ingen skyldighet att påpeka fel i indexet till tredje part, inklusive men inte begränsat till investerare i fonden och/eller finansiella intermediärer i fonden. Varken offentliggörande av index eller licensiering av index eller index varumärke för användning i samband med fonden utgör någon rekommendation från Solactive att investera kapital i fonden, ej heller utgör det inte på något sätt en försäkring eller åsikt från Solactive avseende eventuella investeringar i denna fond.





# Handelsbanken Global Momentum

## Placeringsinriktning

Fonden placerar på de globala aktiemarknaderna med målsättning att erbjuda exponering mot bolag som uppvisar ett positivt riskjusterat momentum. Fonden är regelbaserad och placeringarna i fonden väljs ut genom en kvantitativ förvaltningsmodell i vilken bolag betygsätts och väljs ut utifrån dess riskjusterade momentum över en eller flera tidsperioder. Även andra faktorer, såsom likviditet, börsvärde, omsättning m.m., kan påverka urvalet av bolag och bolagens respektive vikt i fonden. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Placeringsinriktningen är global och inte begränsad till någon särskild bransch eller region. Fonden placerar inte i företag som bekräftats agera i strid med internationella normer och konventioner rörande till exempel mänskliga rättigheter, arbetsvillkor, korruption och miljö. En restriktiv hållning till fossila bränslen tillämpas och fonden placerar inte i bolag med verksamhet inom områdena/branscherna krigsmaterial, tobak, alkohol, kommersiell spelverksamhet, cannabis och pornografi på sätt som beskrivs i informationsbroschyren. Fonden kan dock investera i bolag som är involverade i kraftgenerering, distribution eller tjänster avseende fossila bränslen i de fall bolagen bedöms ställa om sin verksamhet till mer förnyelsebar energi. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. Vi jämför fondens utveckling mot Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Index och bl.a. som följd av den kvantitativa modellens styrande faktorer kan fondens avvikelse mot index förväntas vara relativt hög. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 10,3% under första halvåret 2023\*. De tre största aktieinnehaven vid halvårsskiftet var Apple, Nvidia och Microsoft. De tre största sektorerna utgjorde knappt 60% av portföljen och bestod av informationsteknologi, hälsovård och sällanköpsvaror.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Placeringarna i fonden sker normalt globalt och sprids över ett flertal marknader och sektorer för att erhålla en god diversifiering vilket bidrar till att minska risken i fonden. Då fondens investeringar sker i utländska aktier denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. Då fonden består av olika andelsklasser kan förändringar i valutakurser medföra att riskklassificeringen skiljer sig åt mellan olika andelsklasser beroende på vilken valuta andelsklassen handlas i. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra

tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 1,5%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 1,4%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 1,4%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

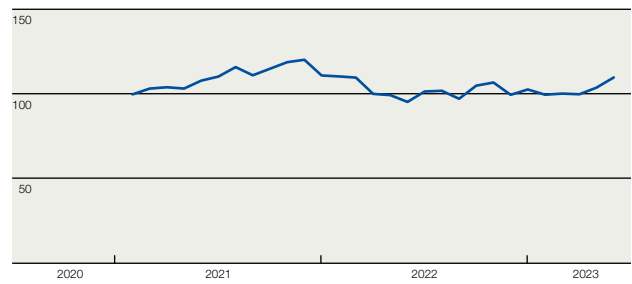
Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Handelsbanken Global Momentum, forts.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Global Momentum A1 - SEK	110,47	100,14	120,98	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - EUR	9,46	9,09	11,86	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - NOK	106,81	92,29	114,86	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - SEK	111,77	101,02	121,34	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - EUR	9,52	9,13	11,88	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - NOK	109,55	94,53	117,30	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum B1 - SEK	102,79	96,54	120,98	-	-	-	-	-	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnSEK										
	3	-1	832	-	-	-	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK										
Global Momentum A1 - SEK	858	775	937	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - EUR	555	498	607	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - NOK	1	1	1	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - SEK	56	48	63	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - EUR	0	0	0	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - NOK	233	203	247	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum B1 - SEK	0	0	0	-	-	-	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental										
Global Momentum A1 - SEK	7 783	7 759	7 770	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - EUR	5 027	4 977	5 021	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - NOK	101	97	91	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - SEK	520	521	545	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - EUR	0	0	0	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - NOK	5	18	5	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum B1 - SEK	2 129	2 145	2 108	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum B1 - SEK	1	1	1	-	-	-	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Global Momentum A1 - SEK	10,3	-17,2	21,0	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - EUR	4,1	-23,4	18,6	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - NOK	15,7	-19,7	14,9	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - SEK	10,6	-16,7	21,3	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - EUR	4,3	-23,1	18,7	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - NOK	15,9	-19,4	15,5	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum B1 - SEK	10,4	-17,3	21,0	-	-	-	-	-	-	-
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Global Momentum A1 - SEK	20,2	-8,9	28,3	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - EUR	13,5	-15,6	25,6	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - NOK	26,1	-11,5	22,1	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - SEK	20,2	-8,9	28,3	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - EUR	13,5	-15,6	25,6	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - NOK	26,1	-11,5	22,1	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum B1 - SEK	20,2	-8,9	28,3	-	-	-	-	-	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Global Momentum A1 - SEK	6,5	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - EUR	6,5	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - NOK	6,5	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - SEK	6,5	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - EUR	6,5	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - NOK	6,5	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum B1 - SEK	6,5	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Global Momentum A1 - SEK	0,9	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - EUR	-6,4	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A1 - NOK	0,1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - SEK	1,4	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - EUR	-6,1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum A9 - NOK	0,4	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Global Momentum B1 - SEK	0,9	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	11,7	-	-	-	-	-	-	-	-	-
EUR	3,6	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NOK	10,9	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK										
	3,29	3,75	-	-	-	-	-	-	-	-
Omräkningskurs EUR/SEK	11,78	11,12	10,30	-	-	-	-	-	-	-
Omräkningskurs NOK/SEK	1,01	1,06	1,03	-	-	-	-	-	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta - historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Developed Markets Index

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd. För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se Information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

Handelsbanken Global Momentum, forts.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Global Momentum A1	0,60
Global Momentum A9	0,30
Global Momentum B1	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Global Momentum A1	0,60
Global Momentum A9	0,30
Global Momentum B1	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Global Momentum A1	0,61
Global Momentum A9	0,31
Global Momentum B1	0,61
Transaktionskostnader, tSEK	464
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,03

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,9
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	0,0
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk % - A1 SEK	15,8	Aktiv avkastning % - B1 SEK	-10,9
Total risk % - A1 EUR	17,1	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk % - A1 NOK	14,2	Informationskvot - A1 EUR	Negativ
Total risk % - A9 SEK	15,8	Informationskvot - A1 NOK	Negativ
Total risk % - A9 EUR	17,1	Informationskvot - A9 SEK	Negativ
Total risk % - A9 NOK	14,2	Informationskvot - A9 EUR	Negativ
Total risk % - B1 SEK	15,8	Informationskvot - A9 NOK	Negativ
Total risk i index % - A1 SEK	14,3	Informationskvot - B1 SEK	Negativ
Total risk i index % - A1 EUR	15,7	Sharpekvot - A1 SEK	0,0
Total risk i index % - A1 NOK	13,1	Sharpekvot - A1 EUR	-0,4
Total risk i index % - A9 SEK	14,3	Sharpekvot - A1 NOK	-0,1
Total risk i index % - A9 EUR	15,7	Sharpekvot - A9 SEK	0,0
Total risk i index % - A9 NOK	13,1	Sharpekvot - A9 EUR	-0,4
Total risk i index % - B1 SEK	14,3	Sharpekvot - A9 NOK	-0,1
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG Developed Markets Index	Sharpekvot - B1 SEK	0,0
Aktiv avkastning % - A1 SEK	-10,9	Sharpekvot i index - A1 SEK	0,8
Aktiv avkastning % - A1 EUR	-10,1	Sharpekvot i index - A1 EUR	0,2
Aktiv avkastning % - A1 NOK	-10,8	Sharpekvot i index - A1 NOK	0,7
Aktiv avkastning % - A9 SEK	-10,3	Sharpekvot i index - A9 SEK	0,8
Aktiv avkastning % - A9 EUR	-9,8	Sharpekvot i index - A9 EUR	0,2
Aktiv avkastning % - A9 NOK	-10,5	Sharpekvot i index - A9 NOK	0,7
		Sharpekvot i index - B1 SEK	0,8

\* Riskmått är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	842 286	98,1	764 496	98,6
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>842 286</b>	<b>98,1</b>	<b>764 496</b>	<b>98,6</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	18 371	2,1	10 897	1,4
Förtbetalda kostnader och upplupna intäkter	1 167	0,1	372	0,0
Övriga tillgångar	2 700	0,3	-	-
<b>Summa tillgångar</b>	<b>864 524</b>	<b>100,7</b>	<b>775 765</b>	<b>100,0</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förtbetalda intäkter	352	0,0	354	0,0
Övriga skulder	5 754	0,7	-	-
<b>Summa skulder</b>	<b>6 107</b>	<b>0,7</b>	<b>354</b>	<b>0,0</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>858 418</b>	<b>100,0</b>	<b>775 410</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	18 919	2,2	52 378	6,8
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	21 251	2,5	57 312	7,4
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	815	0,0	667	0,1

1) Likvida medel 815 tSEK

## Fondens innehav av finansiella instrument

Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES **98,1**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>BERMUDA</b>			
Arch Capital Group	21 100	17 059	2,0
		<b>17 059</b>	<b>2,0</b>
<b>DANMARK</b>			
A.P. Møller-Mærsk A	40	752	0,1
A.P. Møller-Mærsk B	50	948	0,1
Novo Nordisk	11 620	20 218	2,4
		<b>21 918</b>	<b>2,6</b>
<b>FRANKRIKE</b>			
Hermes	750	17 588	2,0
		<b>17 588</b>	<b>2,0</b>
<b>HONGKONG</b>			
Geely Automobile Holdings	36 000	474	0,1
Swire Pacific A	65 000	5 380	0,6
		<b>5 854</b>	<b>0,7</b>
<b>IRLAND</b>			
Delphi Automotive	500	551	0,1
Trane Technologies	100	207	0,0
		<b>758</b>	<b>0,1</b>
<b>ISRAEL</b>			
Meisron	117	82	0,0
Mivne Real Estate KD	2 558	67	0,0
		<b>149</b>	<b>0,0</b>
<b>ITALIEN</b>			
Interpump Group	151	91	0,0
Moncler	1 227	916	0,1
Prada	1 600	116	0,0
Unicredit	75 890	19 017	2,2
		<b>20 140</b>	<b>2,3</b>
<b>JAPAN</b>			
Ajinomoto	300	128	0,0
Asics	55 500	18 337	2,1
Capcom	37 800	16 087	1,9
Isetan Mitsukoshi Holdings	80 700	8 817	1,0
Koel Tecmo Holdings	520	97	0,0
Konami Group	200	112	0,0
Mitsui O.S.K. Lines	2 000	517	0,1
Nissin Food Products	17 300	15 398	1,8
Niterra	69 400	14 952	1,7
Open House Group	200	77	0,0
Renesas Electronics	800	162	0,0
Shin-Etsu Chemical	500	178	0,0
Toyo Suisan Kaisha	27 800	13 510	1,6
Toyota Industries	100	77	0,0
Yakult Honsha	20 600	14 017	1,6
		<b>102 466</b>	<b>11,9</b>
<b>KANADA</b>			
BRP	100	91	0,0
Fairfax Financial Holdings	800	6 480	0,8
Great-West Lifeco	300	94	0,0
Intact Financial	9 500	15 861	1,8
Loblaws Companies	9 600	9 504	1,1
Magna International	125	76	0,0
National Bank of Canada	100	81	0,0
Nuvei Subordinate	100	32	0,0
Power Corporation of Canada	300	87	0,0
TFI International	100	123	0,0
Thomson Reuters	11 567	16 888	2,0
WSP Global	800	1 143	0,1
		<b>50 460</b>	<b>5,9</b>
<b>NEDERLÄNDERNA</b>			
Adyen	29	542	0,1
ASM International	23	105	0,0
ASML Holding	128	1 000	0,1
		<b>1 647</b>	<b>0,2</b>
<b>NYA ZEELAND</b>			
Ebos Group	3 579	870	0,1
Infratil	14 306	961	0,1
Mainfreight	3 127	1 490	0,2
		<b>3 321</b>	<b>0,4</b>
<b>POLEN</b>			
Santander Bank Polska	121	125	0,0
		<b>125</b>	<b>0,0</b>
<b>SCHWEIZ</b>			
Kuehne & Nagel	36	115	0,0
Straumann Holding	50	88	0,0
TE Connectivity	25	38	0,0
		<b>241</b>	<b>0,0</b>
<b>SPANIEN</b>			
ACS Actividades de Construccion y Servicios	44 160	16 741	2,0
		<b>16 741</b>	<b>2,0</b>
<b>STORBRIANNIEN</b>			
Associated British Foods	33 153	9 064	1,1
Next	95	90	0,0
		<b>9 154</b>	<b>1,1</b>

Handelsbanken Global Momentum, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>SVERIGE</b>			
Avanza Bank Holding	267	59	0,0
Epiroc A	425	87	0,0
EQT	183	38	0,0
Hexagon B	6 055	804	0,1
Investor A	420	91	0,0
NIBE Industrier B	745	76	0,0
Sagax B	250	53	0,0
		<b>1 207</b>	<b>0,1</b>
<b>TYSKLAND</b>			
Deutsche Telekom N	62 132	14 626	1,7
E.ON N ORD	122 369	16 843	2,0
Merck KGaA	446	797	0,1
Münchener Rück	4 316	17 476	2,0
Zalando	118	37	0,0
		<b>49 778</b>	<b>5,8</b>
<b>USA</b>			
AbbVie	12 300	17 900	2,1
Aflac	6 600	4 976	0,6
Allstate	100	118	0,0
Ally Financial	247	72	0,0
Ameriprise Financial	300	1 076	0,1
AmerisourceBergen	8 000	16 628	1,9
Analog Devices	93	196	0,0
Apple	19 700	41 274	4,8
Arista Networks	800	1 400	0,2
Atlassian A	26	47	0,0
AutoZone	100	2 693	0,3
Bank of America	2 200	682	0,1
Bank of New York Mellon	1 800	866	0,1
Block	64	46	0,0
Broadcom	400	3 748	0,4
Cadence Design Systems	500	1 267	0,1
Cardinal Health	18 000	18 387	2,1
Cbre Group	100	87	0,0
Celanese A	100	125	0,0
Chewy A	200	85	0,0
Citizens Financial Group	200	56	0,0
Coca-Cola	22 500	14 635	1,7
Cognizant Technology Solutions	100	71	0,0
Comcast A	200	90	0,0
Copart	17 400	17 142	2,0
CrowdStrike Holdings	719	1 141	0,1
CSX	300	110	0,0
Danaher	300	778	0,1
DuPont de Nemours	100	77	0,0
Eli Lilly	4 800	24 315	2,8
Emerson Electric	100	98	0,0
Enphase Energy	5 100	9 226	1,1
EPAM Systems	17	41	0,0
Equity Residential	1 100	784	0,1
Extra Space Storage	100	161	0,0
Fair Isaac	1 900	16 607	1,9
Fifth Third Bancorp	2 300	651	0,1
Fortinet	22 700	18 534	2,2
Freeport McMoRan	3 900	1 685	0,2
Gartner	4 100	15 514	1,8
General Motors	1 400	583	0,1
Genuine Parts	5 500	10 053	1,2
Gilead Science	16 000	13 319	1,6
Globe Life N	300	355	0,0
Hershey	5 900	15 913	1,9
Hewlett-Packard	300	100	0,0
Huntington Bancshares	600	70	0,0
Ingersoll Rand	200	141	0,0
Interactive Brokers Group A	100	90	0,0
Intercontinental Exchange	100	122	0,0
Intuit	3 200	15 837	1,8
Johnson & Johnson	100	179	0,0
JPMorgan Chase & Co	500	785	0,1
Keycorp	400	40	0,0
KKR & Co	100	60	0,0
Lennar B	15 400	18 793	2,2
LKQ	200	126	0,0
Marriott International	800	1 587	0,2
Marsh & McLennan	100	203	0,0
McKesson	3 800	17 539	2,0
Merck & Co	17 400	21 687	2,5
MetLife	500	305	0,0
Microsoft	7 917	29 121	3,4
Mid-America Apartment Communities	400	656	0,1
Mondelez International	200	158	0,0
Motorola Solutions	400	1 267	0,1
NetApp	1 100	908	0,1
Nvidia	7 700	35 183	4,1
O'Reilly Auto Parts	16	165	0,0
ON Semiconductor	17 600	17 980	2,1
Oracle	1 000	1 286	0,1
Packaging	100	143	0,0
Palo Alto Networks	600	1 656	0,2
Paychex	100	121	0,0
PayPal	100	72	0,0
Pepsico	1 300	2 601	0,3
PNC Financial Services Group	400	544	0,1
PPG Industries	100	160	0,0
Procter & Gamble	100	164	0,0
Progressive Ohio	11 300	16 156	1,9
Prudential Financial	100	95	0,0
Pulte Homes	22 500	18 879	2,2
Raymond James	900	1 009	0,1
Regions Financial	400	77	0,0

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
Republic Services	500	827	0,1
Southern Copper	21 300	16 505	1,9
Synchrony Financial	200	73	0,0
Synopsys	600	2 822	0,3
Texas Instrument	100	194	0,0
Thermo Fisher Scientific	200	1 127	0,1
Truist Financial	200	66	0,0
U.S. Bancorp	200	71	0,0
Vail Resorts	300	816	0,1
Vertex Pharmaceuticals	4 700	17 865	2,1
VMware	133	206	0,0
Walmart Stores	100	170	0,0
Walt Disney	100	96	0,0
Wells Fargo	2 000	922	0,1
West Pharmaceutical Services	300	1 239	0,1
Weyerhaeuser	300	109	0,0
Zscaler	30	47	0,0
		<b>522 832</b>	<b>60,9</b>
<b>ÖSTERRIKE</b>			
Raiffeisen Bank International	346	59	0,0
Verbund	912	789	0,1
		<b>849</b>	<b>0,1</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>842 286</b>	<b>98,1</b>

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 0,0**

	Underliggande exponering tSEK	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
E-mini S&P 500 ESG Sep 2023	12 887	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>842 286</b>	<b>98,1</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		16 132	1,9
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>858 418</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

### Sammanställning, företags- och koncernexponeringar\*

**Företag/koncern % av fondförmögenheten**

AP Möller Maersk 0,2

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehåller mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

Handelsbanken Global Momentum, forts.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

Volym utlånade värdepapper, tSEK	18 919
----------------------------------	--------

Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar	2,2
---	-----

**De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:**

Nvidia	598
Genuine Parts	479
Deere & Co	471
Amerikanska staten	466
Starbucks	466
Keysight Technologies	421
Abbvie	408
Lockheed Martin	408
Masco	407
NXP Semiconductors NV	406

**De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:**

Barclays Bank	12 070
UBS AG London Branch	9 061
BNP Paribas Arbitrage SNC	69
Citigroup Global Markets	52

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:**

Aktier	20 479
Obligationer och andra räntebärande instrument	772
	21 251

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	3
En till tre månader	2
Tre månader till ett år	5
Mer än ett år	762
Obestämd löptid	20 479
	21 251

**Motparternas hemvist, tSEK**

Frankrike	69
Storbritannien	21 182
	21 251

**Säkerheternas valuta, tSEK**

AUD	169
CHF	9
DKK	0
EUR	214
GBP	396
HKD	14
JPY	2 830
NZD	0
SGD	2
USD	17 618
	21 251

**Avveckling och clearing, tSEK**

Tredje part	21 251
	21 251

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 72 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- Barclays Bank
- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- HSBC Bank
- Merrill Lynch International
- UBS AG London Branch



# Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index NTR så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet kommer att efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet av de aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,5%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagsändelser ger samliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet är återinvestering, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet, justerat för skatt. Indexet syftar till att återspegla utvecklingen för småbolag globalt på de utvecklade aktiemarknaderna exklusive de bolag som inte uppfyller indexets hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven i indexet syftar till en minskning av koldioxidutsläppen och bolagen i index väljs ut och viktas på så sätt att indexportföljens utsläpp av växthusgaser anpassas till de långsiktiga globala uppvärmningsmålen i Parisavtalet. Hållbarhetskraven i index innebär vidare att bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer, bolag som avsevärt skadar miljömässiga mål samt bolag som är verksamma inom kontroversiella sektorer inte ingår i index. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 12,6% under första halvåret 2023\*. De tre största aktieinnehaven i fonden var vid halvårsskiftet Ferguson, Monolithic Power Systems och Insulet. De största sektorerna i fonden var industrivaror och -tjänster, finans och informationsteknik. Fonden följer ett index som är i linje med Parisavtalets klimatmål så kallat EU Paris Aligned Benchmarks. Denna utveckling är ett viktigt steg på vägen att nå fondbolagets mål om nettonollutsläpp i våra portföljer till år 2040 samt att linjera allt vårt förvaltda kapital i enlighet med Parisavtalets målsättningar.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar sker globalt men med viss koncentration i aktier noterade i USA. Fondens placeringar fördelas över företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Fondens placeringsinriktning innebär exponering mot mindre bolag där likviditeten ofta är lägre, och variationen i likviditet generellt bedöms vara förhöjd jämfört med aktiemarknaden i stort. Detta kan komma att påverka fondens möjligheter att hantera stora utflöden till en begränsad kostnad. Då fondens investeringar sker i utländska aktier denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. Då fonden består av olika andelsklasser kan förändringar i valutakurser medföra att värdet och riskklassificeringen skiljer sig åt mellan olika andelsklasser beroende på vilken valuta andelsklassen handlas i. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

• Högsta hävstång under räkenskapsåret	1,4%
• Lägst hävstång under räkenskapsåret	0,0%
• Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret	0,8%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de

Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

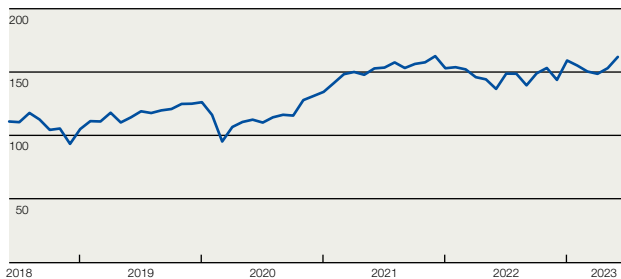
Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns

under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

### Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

### Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Global Småbolag Index Criteria A1 - SEK	165,25	146,78	165,87	133,86	127,66	95,39	101,12	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - EUR	14,02	13,20	16,11	13,32	12,15	9,41	10,29	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - NOK	163,91	138,77	161,56	139,55	119,84	93,17	101,02	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A4 - SEK	168,07	149,06	167,95	135,12	128,49	95,72	101,17	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - SEK	167,91	148,92	167,78	134,99	128,36	95,63	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - EUR	14,25	13,39	16,30	13,43	12,22	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - NOK	139,47	117,67	136,59	117,63	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria B1 - SEK	133,19	123,13	145,10	121,98	120,95	92,71	-	-	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	1 798	-2 849	74	627	663	3 427	4 019	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK										
Global Småbolag Index Criteria A1 - SEK	12 923	9 790	14 122	11 336	10 075	6 999	4 069	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - EUR	11 716	8 732	12 529	9 948	8 934	6 316	1 829	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - NOK	4	3	4	2	3	0	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A4 - SEK	42	35	136	24	15	4	7	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - SEK	208	213	484	533	694	467	2 232	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - EUR	360	275	234	227	126	34	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - NOK	4	3	4	3	0	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - SEK	239	204	301	270	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria B1 - SEK	263	242	343	292	284	148	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental										
Global Småbolag Index Criteria A1 - SEK	78 778	67 226	85 720	85 209	79 006	73 397	40 230	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - EUR	70 897	59 489	75 536	74 319	69 979	66 204	18 083	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - NOK	267	262	272	186	164	316	22	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A4 - SEK	253	250	841	173	122	43	66	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - SEK	1 238	1 427	2 884	3 948	5 405	4 877	22 059	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - EUR	2 141	1 848	1 393	1 679	981	360	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - NOK	287	253	227	216	3	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - SEK	1 716	1 730	2 204	2 293	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria B1 - SEK	1 978	1 967	2 363	2 395	2 352	1 596	-	-	-	-
Total avkastning i % <sup>1)</sup>										
Global Småbolag Index Criteria A1 - SEK	12,6	-11,5	23,9	4,9	33,8	-5,7	1,1	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - EUR	6,2	-18,1	20,9	9,6	29,1	-8,5	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - NOK	18,1	-14,1	15,8	16,5	28,6	-7,8	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A4 - SEK	12,8	-11,2	24,3	5,2	34,2	-5,4	1,2	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - SEK	12,8	-11,2	24,3	5,2	34,2	-5,4	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - EUR	6,4	-17,8	21,3	10,0	29,5	-8,2	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - NOK	18,5	-13,8	16,1	16,8	29,0	-7,5	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria B1 - SEK	12,7	-11,5	23,9	5,0	33,8	-5,7	-	-	-	-
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Global Småbolag Index Criteria A1 - SEK	12,9	-11,3	25,2	5,6	34,3	-5,5	1,4	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - EUR	6,6	-17,9	22,2	10,5	29,6	-8,3	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - NOK	18,5	-13,9	17,0	17,3	29,1	-7,6	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A4 - SEK	12,9	-11,3	25,2	5,6	34,3	-5,5	1,4	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - SEK	12,9	-11,3	25,2	5,6	34,3	-5,5	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - EUR	6,6	-17,9	22,2	10,5	29,6	-8,3	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - NOK	18,5	-13,9	17,0	17,3	29,1	-7,6	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria B1 - SEK	12,9	-11,3	25,2	5,6	34,3	-5,5	-	-	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Global Småbolag Index Criteria A1 - SEK	0,2	0,2	0,4	0,4	0,3	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - EUR	0,2	0,2	0,4	0,4	0,3	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - NOK	0,2	0,2	0,4	0,4	0,3	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A4 - SEK	0,2	0,2	0,4	0,4	0,3	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - SEK	0,2	0,2	0,4	0,4	0,3	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - EUR	0,2	0,2	0,4	0,4	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - NOK	0,2	0,2	0,4	0,4	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria B1 - SEK	0,2	0,2	0,4	0,4	0,3	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Global Småbolag Index Criteria A1 - SEK	2,9	4,7	14,0	18,5	12,4	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - EUR	-4,5	-0,5	15,2	19,0	8,7	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - NOK	2,2	-0,3	16,1	22,4	8,9	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A4 - SEK	3,2	5,0	14,3	18,8	12,7	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - SEK	3,2	5,0	14,3	18,8	12,7	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - EUR	-4,2	-0,2	15,5	19,3	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - NOK	2,6	0,0	16,5	22,8	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria B1 - SEK	2,9	4,7	14,1	18,5	12,4	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	3,5	5,4	15,0	19,1	12,7	-	-	-	-	-
EUR	-4,0	0,2	16,2	19,6	9,0	-	-	-	-	-
NOK	2,8	0,4	17,2	23,1	9,2	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										

Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

Global Småbolag Index Criteria A1 - SEK	7,8	7,7	-	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - EUR	5,3	5,1	-	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A1 - NOK	9,7	6,6	-	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A4 - SEK	8,2	8,1	-	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - SEK	8,2	8,1	-	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - EUR	5,6	5,4	-	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria A9 - NOK	10,0	6,9	-	-	-	-	-	-	-
Global Småbolag Index Criteria B1 - SEK	7,9	7,8	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %									
SEK	8,4	8,3	-	-	-	-	-	-	-
EUR	5,8	5,7	-	-	-	-	-	-	-
NOK	10,3	7,1	-	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK	4,98	5,39	5,47	4,23	2,78	-	-	-	-
Omräkningskurs EUR/SEK	11,78	11,12	10,30	10,05	10,51	10,13	9,83	-	-
Omräkningskurs NOK/SEK	1,01	1,06	1,03	0,96	1,07	1,02	1,00	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta – historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.  
1) En justering har gjorts under 2023, vilket förklarar varför avkastningen mellan andelsklasserna skiljer sig åt. Justeringen påverkar inte det faktiska värdet i andelsklasserna.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index

T o m 2019-02-28: MSCI World Small Cap Select Global Norms &amp; Criteria Index

T o m 2021-05-20: Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fonddrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Global Småbolag Index Criteria A1	0,60
Global Småbolag Index Criteria A4	0,30
Global Småbolag Index Criteria A9	0,30
Global Småbolag Index Criteria B1	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Global Småbolag Index Criteria A1	0,60
Global Småbolag Index Criteria A4	0,30
Global Småbolag Index Criteria A9	0,30
Global Småbolag Index Criteria B1	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Global Småbolag Index Criteria A1	0,63
Global Småbolag Index Criteria A4	0,33
Global Småbolag Index Criteria A9	0,33
Global Småbolag Index Criteria B1	0,63
Transaktionskostnader, tSEK	3 864
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,04

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,2
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	0,0
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmätt \*

Total risk % - A1 SEK	15,7	Aktiv avkastning % - B1 SEK	-0,6
Total risk % - A1 EUR	17,4	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk % - A1 NOK	13,6	Informationskvot - A1 EUR	Negativ
Total risk % - A4 SEK	15,7	Informationskvot - A1 NOK	Negativ
Total risk % - A9 SEK	15,7	Informationskvot - A4 SEK	Negativ
Total risk % - A9 EUR	17,4	Informationskvot - A9 SEK	Negativ
Total risk % - A9 NOK	13,6	Informationskvot - A9 EUR	Negativ
Total risk % - B1 SEK	15,7	Informationskvot - A9 NOK	Negativ
Total risk i index % - A1 SEK	15,8	Informationskvot - B1 SEK	Negativ
Total risk i index % - A1 EUR	17,5	Sharpekvot - A1 SEK	0,1
Total risk i index % - A1 NOK	13,6	Sharpekvot - A1 EUR	-0,3
Total risk i index % - A4 SEK	15,8	Sharpekvot - A1 NOK	0,1
Total risk i index % - A9 SEK	15,8	Sharpekvot - A4 SEK	0,2
Total risk i index % - A9 EUR	17,5	Sharpekvot - A9 SEK	0,2
Total risk i index % - A9 NOK	13,6	Sharpekvot - A9 EUR	-0,3
Total risk i index % - B1 SEK	15,8	Sharpekvot - A9 NOK	0,1
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG	Sharpekvot - B1 SEK	0,1
	Screened Paris Aligned	Sharpekvot i index - A1 SEK	0,2
	Developed Markets	Sharpekvot i index - A1 EUR	-0,3
	Small Cap Index	Sharpekvot i index - A1 NOK	0,1
Aktiv avkastning % - A1 SEK	-0,6	Sharpekvot i index - A4 SEK	0,2
Aktiv avkastning % - A1 EUR	-0,5	Sharpekvot i index - A9 SEK	0,2
Aktiv avkastning % - A1 NOK	-0,6	Sharpekvot i index - A9 EUR	-0,3
Aktiv avkastning % - A4 SEK	-0,3	Sharpekvot i index - A9 NOK	0,1
Aktiv avkastning % - A9 SEK	-0,3	Sharpekvot i index - B1 SEK	0,2
Aktiv avkastning % - A9 EUR	-0,3		
Aktiv avkastning % - A9 NOK	-0,2		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fonddrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	12 826 121	99,3	9 737 532	99,5
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>12 826 121</b>	<b>99,3</b>	<b>9 737 532</b>	<b>99,5</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	184 426	1,4	40 497	0,4
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	14 315	0,1	13 932	0,1
Övriga tillgångar	24 045	0,2	24 902	0,3
<b>Summa tillgångar</b>	<b>13 048 907</b>	<b>101,0</b>	<b>9 816 863</b>	<b>100,3</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	6 180	0,0	5 210	0,1
Övriga skulder	120 144	0,9	21 881	0,2
<b>Summa skulder</b>	<b>126 324</b>	<b>1,0</b>	<b>27 091</b>	<b>0,3</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>12 922 583</b>	<b>100,0</b>	<b>9 789 772</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	2 083 394	16,1	1 834 890	18,7
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	2 307 225	17,9	2 011 649	20,5
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	6 128	0,0	3 318	0,0

1) Likvida medel 6 128 tSEK

## Fondens innehav av finansiella instrument

Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES **99,1**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>			
Abacus Property Group Units	176 658	3 417	0,0
Accent Group	125 122	1 507	0,0
Adbri	51 828	891	0,0
ALS	83 166	6 673	0,1
Allium	14 308	3 798	0,0
AMP	240 974	1 958	0,0
Ansell	22 093	4 246	0,0
AP Eagers	39 580	3 839	0,0
ARB	17 162	3 529	0,0
Arena REIT	114 973	3 108	0,0
AUB Group	457	97	0,0
Bank of Queensland	128 193	5 060	0,0
Bega Cheese	40 563	831	0,0
BelleVue Gold	251 678	2 298	0,0
Bendigo Bank	92 347	5 703	0,0
Blackmores	4 744	3 214	0,0
Boss Energy	39 067	871	0,0
BrainChip Holdings	580 257	1 523	0,0
Breville Group	23 793	3 411	0,0
Burson Group	72 358	3 090	0,0
BWP Trust	177 646	4 636	0,0
Capricorn Metal	60 092	1 741	0,0
Chalice Gold Mines	69 108	3 110	0,0
Challenger	102 755	4 787	0,0
Champion Iron	77 557	3 390	0,0
Charter Hall Retail REIT	225 187	5 845	0,0
Cleanaway	295 920	5 511	0,0
Clinuvel Pharmaceuticals	7 853	1 010	0,0
Codan	21 646	1 250	0,0
Core Lithium	271 866	1 759	0,0
Costa Group	140 636	2 750	0,0
Cromwell Property	763 772	2 938	0,0
CSR	103 499	3 862	0,0
CTM	15 622	2 009	0,0
De Grey Mining	275 957	2 669	0,0



Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusenatal	Marknads- värde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusenatal	Marknads- värde ISEK	% av fondförm.
Dicker Data	10 532	621	0,0	RenaissanceRe	5 900	11 886	0,1
Domain Holdings Australia	86 849	2 367	0,0	Roivant Sciences	67 000	7 295	0,1
Downer EDI	104 231	3 080	0,0	Signet Jewelers	9 100	6 415	0,0
DRR	105 585	3 492	0,0	SiriusPoint	28 088	2 740	0,0
Flight Centre	30 216	4 139	0,0	Textainer Group Holdings	12 600	5 359	0,0
G.U.D Holdings	37 116	2 354	0,0	Triton International	11 702	10 524	0,1
G8 Education	203 292	1 520	0,0			<b>146 432</b>	<b>1,1</b>
Gold Road Resources	232 115	2 478	0,0	<b>BRITTISKA JUNGFRUÖARNA</b>			
Harvey Norman	116 490	2 915	0,0	Capri Holdings	24 400	9 459	0,1
Healius	88 849	2 031	0,0	Establishment Labs	5 200	3 854	0,0
HomeCo Daily Needs REIT	501 356	4 236	0,0	Nomad Foods	25 600	4 845	0,0
Hub24	10 808	1 978	0,0			<b>18 157</b>	<b>0,1</b>
Iluka Resources	69 301	5 536	0,0	<b>CAYMANÖARNA</b>			
Imdex	112 728	1 532	0,0	Ambarella	8 044	7 270	0,1
Imugene	627 318	410	0,0	Credo Technology Group	3 200	599	0,0
Ingenia Communities	98 245	2 811	0,0	Fabrinet	4 500	6 313	0,0
Insignia Financial	137 351	2 785	0,0	Herbalife	16 118	2 305	0,0
InvoCare	36 513	3 305	0,0			<b>16 487</b>	<b>0,1</b>
IPL	203 248	4 004	0,0	<b>COLOMBIA</b>			
Iress	31 109	2 293	0,0	Tecnoglass	2 500	1 395	0,0
Jb Hi-Fi	22 918	7 209	0,1			<b>1 395</b>	<b>0,0</b>
Johns Lyng Group	43 414	1 661	0,0	<b>DANMARK</b>			
Kelsian Group	48 022	2 507	0,0	ALK-Abello B	26 877	3 167	0,0
Lifestyle Communities	23 399	2 635	0,0	Alm Brand	172 565	2 917	0,0
Link Administration Holding	28 804	346	0,0	Ambu B	37 259	6 584	0,1
Liontown	339 115	6 900	0,1	Ascendis Sp ADS	9 000	8 676	0,1
Lovisa Holdings	17 763	2 465	0,0	Bavarian Nordic	17 432	5 352	0,0
McMillan Shakespeare	22 160	2 877	0,0	D/S Norden	1 848	996	0,0
Nanosonics	79 228	2 700	0,0	DFDS	6 512	2 560	0,0
National Storage REIT	321 743	5 436	0,0	FLSmidth	8 077	4 221	0,0
Netwealth Group	24 252	2 413	0,0	GN Store Nord	24 631	6 635	0,1
Neuren Pharmaceuticals	12 407	1 093	0,0	H. Lundbeck B	37 815	1 941	0,0
Nextdc	81 372	7 360	0,1	ISS	27 384	6 252	0,0
NIB Holdings	75 601	4 593	0,0	Jyske Bank	7 803	6 402	0,0
Nick Scali	25 995	1 703	0,0	Netcompany Group	8 991	4 018	0,0
Nickel Industries	213 412	1 358	0,0	NKT	9 822	6 432	0,0
Nine Entertainment	259 330	3 664	0,0	Ringkjøbing Landbobank	4 570	7 070	0,1
Nufarm	71 105	2 602	0,0	Rockwool B	1 111	3 100	0,0
OceanaGold	146 926	3 130	0,0	Schouw & Co.	5 303	4 524	0,0
Ooh!Media	136 453	1 158	0,0	SimCorp	6 828	7 813	0,1
Orora	161 678	3 824	0,0	Sydbank	13 585	6 777	0,1
Paladin Res	695 276	3 649	0,0	Topdanmark	12 026	6 380	0,0
Perenti	106 878	788	0,0			<b>101 816</b>	<b>0,8</b>
Perpetual	18 187	3 384	0,0	<b>FINLAND</b>			
Perseus Mining	238 091	2 825	0,0	Cargotec	5 481	3 252	0,0
Pexa Group	3 830	375	0,0	Kemira	27 116	4 662	0,0
Pinnacle	26 354	1 891	0,0	Kojamo	37 120	3 771	0,0
Platinum	133 191	1 666	0,0	Konecranes	8 739	3 795	0,0
Polynovo	182 761	2 030	0,0	Metsä Board	37 544	2 991	0,0
Premier Investments	26 796	3 903	0,0	Nokia Tyres	16 305	1 534	0,0
Pro Medicus	8 872	4 187	0,0	Outokumpu	56 513	3 265	0,0
PWR Holdings	10 490	654	0,0	Ot Group	3 318	2 990	0,0
Qube Holdings	341 950	7 007	0,1	Revenio	3 707	1 386	0,0
Ramelius Resources	155 909	1 412	0,0	TietoEvyry	17 128	5 103	0,0
Region Group REIT	318 023	5 190	0,0	Uponor	6 874	2 320	0,0
Regis Resources	133 915	1 762	0,0	Valmet	7 840	2 354	0,0
Reliance Worldwide	135 484	3 994	0,0			<b>37 421</b>	<b>0,3</b>
Sandfire Resources	80 863	3 430	0,0	<b>FRANKRIKE</b>			
Sayona Mining	1 295 115	1 630	0,0	Accor	39 051	15 656	0,1
Silver Lake Resources	192 096	1 333	0,0	Air France-KLM	254 809	5 174	0,0
Sims	31 131	3 525	0,0	Aid International	22 517	2 602	0,0
Steadfast Group	172 646	7 448	0,1	Alstom	64 891	20 891	0,2
Syrah Resources	69 309	451	0,0	Amundi	1 874	1 194	0,0
Technology One	45 909	5 166	0,0	Arkema	12 292	12 501	0,1
Telix Pharmaceuticals	34 298	2 767	0,0	BIC	6 166	3 815	0,0
Tyro Payments	65 467	537	0,0	Bureau Veritas	49 740	14 724	0,1
Vulcan Energy Resources	15 112	455	0,0	Coface	4 902	729	0,0
Webjet	73 711	3 662	0,0	Constellium	18 000	3 344	0,0
West African Resources	228 198	1 419	0,0	Criteo ADR	11 700	4 264	0,0
Worleyparsons	67 004	7 607	0,1	Edenred	45 065	32 575	0,3
		<b>311 999</b>	<b>2,4</b>	Eiffage	15 438	17 388	0,1
<b>BELGIEN</b>				Elis	36 382	7 631	0,1
Aedifica R	6 568	94	0,0	Eramet	1 220	1 203	0,0
Aedifica REIT	6 568	4 543	0,0	Eurazeo	8 026	6 096	0,0
Barco	20 142	5 421	0,0	Eurotunnel	68 948	12 659	0,1
Bekaert	7 500	3 668	0,0	Eutelsat Communications	38 363	2 701	0,0
Belgian Post Group	21 721	1 030	0,0	Foncière des Régions	10 631	5 410	0,0
Cofinimmo REIT	5 803	4 705	0,0	Forvia SE	30 464	7 744	0,1
Galapagos	8 332	3 669	0,0	Gecina REIT	12 269	14 104	0,1
KBC Ancora	9 354	4 616	0,0	Groupe SEB	4 679	5 219	0,0
Kinopolis	4 076	1 981	0,0	lcade	7 624	3 430	0,0
Melexis	3 841	4 069	0,0	Imerys	6 279	2 642	0,0
Montea	219	182	0,0	Interparfums	1 493	1 149	0,0
VGP	1 770	1 867	0,0	Ipsen	6 830	8 870	0,1
		<b>35 847</b>	<b>0,3</b>	JCDecaux	12 457	2 680	0,0
<b>BERMUDA</b>				Klépierre	50 053	13 401	0,1
Argo Group	5 659	1 810	0,0	Necan Promesses	16 221	5 543	0,0
Assured Guaranty	11 904	7 175	0,1	Nexans	2 094	1 958	0,0
Axis Capital Holdings	22 500	13 082	0,1	Nexity	11 053	2 410	0,0
Bank of NT Butterfield & Son	10 900	3 221	0,0	Ovñ Groupe	2 300	256	0,0
Enstar Group	2 186	5 767	0,0	Plastic Omnium	6 341	1 202	0,0
Essent Group	18 981	9 595	0,1	Publicis Group	40 718	35 267	0,3
Flow Traders	7 355	1 753	0,0	Renault	30 977	14 083	0,1
Genpact	38 500	15 623	0,1	Rexel	47 819	12 741	0,1
Golden Ocean Group	18 258	1 487	0,0	Scor	24 977	7 915	0,1
Helen Of Troy	3 451	4 026	0,0	Soitec	4 272	7 801	0,1
Hiscox	52 817	7 913	0,1	Sopra Steria	2 990	6 441	0,0
Lancashire Holdings	41 419	3 288	0,0	SPIE	24 115	8 412	0,1
Lazard	15 800	5 461	0,0	TF1	30 632	2 272	0,0
Liberty Latin America A	26 900	2 542	0,0				
Norwegian Cruise Line	82 800	19 470	0,2				



Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
House Foods Group	15 100	3 617	0,0	Olisix Ra Daich	7 800	1 433	0,0
Hyakugo Bank	83 100	2 596	0,0	Oki Electric Industry	42 500	2 855	0,0
Inaba Denkisangyo	21 100	5 164	0,0	Okuma	7 800	4 480	0,0
Industrial & Infrastructure Fund Invest REIT	448	5 076	0,0	Okumura	12 900	3 924	0,0
Infomart	35 900	880	0,0	Onward Holdings	54 500	1 621	0,0
Insource	13 200	1 163	0,0	Open Door	5 500	529	0,0
Internet Initiative Japan	15 200	3 068	0,0	Osaka Titanium Technologies	8 800	1 933	0,0
Invincible Investment REIT	1 419	6 066	0,0	OSG	24 100	3 707	0,0
Iriso Electronics	7 800	2 428	0,0	Outsourcing	22 800	2 320	0,0
Itoham Yonekyu Holdings	40 500	2 191	0,0	Pal Group Holdings	5 400	1 568	0,0
J Trust	26 500	852	0,0	Paltac	4 300	1 533	0,0
Jafco Group	16 700	2 300	0,0	Penta-Ocean Construction	59 900	3 456	0,0
Japan Airport Terminal	13 000	6 315	0,0	Peptidream	15 500	2 479	0,0
Japan Elevator Service Holdings	13 200	1 856	0,0	Pigeon	6 900	1 023	0,0
Japan Hotel Investment REIT	1 074	5 899	0,0	Pilot	9 600	3 268	0,0
Japan Lifeline	23 000	1 770	0,0	Prima Meat Packers	9 600	1 557	0,0
Japan Material	20 700	3 696	0,0	Rakul	11 200	1 124	0,0
Japan Rental Housing Investments REIT	478	4 087	0,0	Relo Group	23 600	3 448	0,0
Japan Steel Works	9 500	2 184	0,0	Rengo	44 100	2 920	0,0
JCR Pharmaceuticals	20 500	1 944	0,0	Renova	5 300	642	0,0
Jeol	10 100	3 845	0,0	Resortrust	15 200	2 423	0,0
Jins	7 200	1 600	0,0	Rorze	3 200	2 776	0,0
Jmdc	5 000	2 131	0,0	Round One	45 000	1 913	0,0
Jtower	2 600	1 335	0,0	RS Technologies	3 400	811	0,0
Justsystems	4 800	1 438	0,0	S-Pool	16 600	654	0,0
K'S Holdings	35 400	3 321	0,0	Sakata Seed	9 100	2 832	0,0
Kadokawa Dwango	14 900	3 830	0,0	San In Godo Bank	39 700	2 391	0,0
Kagome	16 300	3 833	0,0	SanBio	13 100	599	0,0
Kaken Pharmaceutical	10 400	2 799	0,0	Sangetsu	23 200	4 305	0,0
Kandenko	43 500	3 761	0,0	Sanken Electric O	4 600	4 617	0,0
Kaitas	13 500	2 500	0,0	Sankyu	9 600	3 406	0,0
KeePer Tech Lab	5 000	1 823	0,0	Sanrio	13 900	6 406	0,0
Kinden	25 700	3 737	0,0	Sansan	9 500	1 193	0,0
Kohnan Shoji	9 500	2 485	0,0	Sanwa Holdings	54 000	7 528	0,1
Kokuyo	29 200	4 311	0,0	Seino Holdings	26 500	4 050	0,0
Konica Minolta Holdings	114 000	4 245	0,0	Sekisui House REIT	817	5 123	0,0
Koshidaka Holdings	8 500	764	0,0	Shift	1 900	3 719	0,0
Kotobuki Spirits	5 100	4 009	0,0	Shiga Bank	8 299	1 675	0,0
Kumagai	7 600	1 749	0,0	Shinmaywa Industries	19 700	1 987	0,0
Kusuri No Aoki Holdings	5 800	3 510	0,0	Ship Healthcare Holdings	13 100	2 330	0,0
KYORIN Pharmaceutical	18 000	2 355	0,0	Sho-Bond Holdings	10 600	4 528	0,0
Kyoritsu Maintenance	6 500	2 654	0,0	Shochiku	3 400	2 785	0,0
Kyudenko	9 800	2 827	0,0	Shoei	11 900	2 364	0,0
Lasalle Logiport REIT	539	6 086	0,0	Skylark	48 800	6 566	0,1
Leopalace 21	59 600	1 189	0,0	SMS	10 500	2 254	0,0
LinTec	21 700	3 683	0,0	Snow Peak	7 100	993	0,0
M&A Cap Partners	2 100	523	0,0	Sosei Group	13 700	1 536	0,0
Makino Milling Machine	6 600	2 752	0,0	Sotetsu Holdings	24 400	4 623	0,0
Mandom	19 900	2 150	0,0	Sre Holdings	4 200	1 199	0,0
Mani	24 300	3 083	0,0	Strike	3 800	984	0,0
Maruha Nichiro	6 700	1 212	0,0	Sumitomo Bakelite	6 400	2 854	0,0
Maruwa	2 500	4 151	0,0	Sumitomo Forestry	31 700	8 251	0,1
Matsui Securities	51 600	3 062	0,0	Sumitomo Mitsui Construction	36 900	1 020	0,0
MCJ	30 600	2 289	0,0	Systema	66 600	1 453	0,0
Megmilk Snow Brand	6 400	934	0,0	Tadano	20 300	1 736	0,0
Meiko Electronics	7 800	1 571	0,0	Takara Bio	10 400	1 281	0,0
Meitec	16 000	2 958	0,0	Takashimaya	31 100	4 679	0,0
Menicon	13 100	2 456	0,0	Takuma	23 300	2 570	0,0
Micronics Japan	10 300	1 539	0,0	TechnoPro	16 500	3 826	0,0
Milbon	6 700	2 460	0,0	The 77 Bank	14 000	2 678	0,0
Miraca Holdings	13 100	2 694	0,0	The Kiyu Bank	22 900	2 526	0,0
Mirai REIT	961	3 318	0,0	Toagosei	37 800	3 638	0,0
Mitsubishi Logistics	17 100	4 535	0,0	Toda	63 900	3 858	0,0
Mitsui High Tec	4 800	3 505	0,0	Toho Titanium	7 800	1 017	0,0
Mitsui Mining & Smelting	9 900	2 448	0,0	Tokai Carbon	42 000	4 137	0,0
MIXI	5 800	1 159	0,0	Tokai Rika	16 800	2 670	0,0
Mochida Pharmaceutical	13 400	3 295	0,0	Tokai Tokyo Financial Holdings	106 700	3 046	0,0
Monex Group	32 600	1 345	0,0	Tokuyama	2 400	425	0,0
Money Forward	8 100	3 438	0,0	Tokyo Ohka Kogyo	8 600	5 637	0,0
Mori Seiki	25 600	4 760	0,0	Tokyo Seimitsu	10 500	6 223	0,0
Morinaga	11 200	3 771	0,0	Tokyo Tatemono	48 800	6 749	0,1
Morinaga Milk Industry	7 100	2 503	0,0	Tomy	26 700	3 612	0,0
Nachi-Fujikoshi	6 300	1 921	0,0	Topcon	24 800	3 907	0,0
Nagase	33 300	5 946	0,0	Topre	17 100	2 027	0,0
Nakanishi	19 800	4 705	0,0	Towa	10 200	1 952	0,0
Nankai Electric Railway	30 300	7 291	0,1	Toyo Gosei	1 900	1 464	0,0
NEC Networks & System Integration	18 600	2 758	0,0	Toyo Ink Sc Holdings	22 600	3 673	0,0
Net One Systems	13 700	3 224	0,0	Toyo Tire & Rubber	6 100	868	0,0
Nextage	13 300	2 770	0,0	Toyobo	26 000	2 000	0,0
NHK Spring	28 900	2 264	0,0	Tri Chemical Laboratories	11 200	2 334	0,0
Nichias	18 300	4 089	0,0	Trusco Nakayama	15 000	2 549	0,0
Nichiha	11 600	2 666	0,0	TS Tech	27 800	3 769	0,0
Nifco	21 900	6 970	0,1	Tsubakimoto Chain	14 100	3 862	0,0
Nihon Kohden	18 900	5 427	0,0	Tsumura	21 000	4 178	0,0
Nihon Parkerizing	26 100	2 085	0,0	Ulvac	8 800	4 006	0,0
Nikkon Holdings	16 200	3 472	0,0	Unipres	10 500	907	0,0
Nippon Kayaku	50 300	4 616	0,0	Ushio	26 600	3 852	0,0
Nippon Light Metal	23 380	2 530	0,0	UT Group	5 800	1 307	0,0
Nippon Shokubai	7 700	3 090	0,0	Vector	10 900	1 091	0,0
Nipro	45 400	3 459	0,0	Vision	9 600	1 319	0,0
Nishi Nippon Railroad	23 900	4 366	0,0	Visional	700	415	0,0
Nishi-Nippon Financial Holdings	33 000	3 144	0,0	Wacoal Holdings	16 600	3 586	0,0
Nishimatsu Construction	12 300	3 217	0,0	Wacom	51 200	2 250	0,0
Nishimatsuya Chain	18 200	2 316	0,0	West Holdings	4 600	857	0,0
Nissha	8 000	1 003	0,0	YA-MAN	17 000	1 278	0,0
Nisshinbo Industries	34 000	3 024	0,0	Yaoko	3 300	1 781	0,0
Nissui	20 000	966	0,0	yogin Holdings	43 400	2 622	0,0
Noevir Holdings	7 400	3 025	0,0	Yonex	8 600	890	0,0
Nomura	29 500	2 172	0,0	Yoshinoya Holdings	13 100	2 500	0,0
North Pacific Bank	107 900	2 290	0,0	Zenkoku Hoshu	16 200	6 051	0,0
NTN	124 100	2 814	0,0	Zensho Holdings	12 200	5 836	0,0
Ogaki Kyoritsu Bank	13 700	1 886	0,0	Zeon Japan	31 300	3 250	0,0

807 460 6,2





Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
Pentair	33 400	23 305	0,2	Aurubis	4 531	4 194	0,0
Pepco Group	18 087	1 770	0,0	Auto1 Group	17 549	1 758	0,0
Pets at Home Group	97 898	5 063	0,0	Bechtle	12 209	5 225	0,0
Premier Foods	80 934	1 416	0,0	Bilfinger	8 944	3 754	0,0
PZ Cussons	66 378	1 477	0,0	Brenntag SE	31 798	26 755	0,2
Quilter	269 443	2 930	0,0	Cancom	5 086	1 663	0,0
Redrow	71 351	4 321	0,0	Commerzbank	151 116	18 075	0,1
Renishaw	7 930	4 249	0,0	Compugroup Medical N	3 282	1 744	0,0
RS Group	83 453	8 712	0,1	Covestro	25 507	14 302	0,1
RWS Holdings	29 450	952	0,0	CTS Eventim	10 379	7 076	0,1
S4 Capita	68 058	1 178	0,0	Curevac	14 453	1 650	0,0
Safestore Holdings	48 094	5 607	0,0	Dermapharm Holding	2 075	1 108	0,0
Savills	31 307	3 659	0,0	Deutsche Lufthansa	175 271	19 372	0,1
Smart Metering Systems	19 160	1 810	0,0	Deutsche Pfandbrief	26 162	2 066	0,0
Softcat	23 618	4 592	0,0	Duerr	9 992	3 490	0,0
Spectris	18 596	9 180	0,1	Encavis	26 499	4 692	0,0
Spirent Communications	131 568	2 956	0,0	Energiekontor	740	611	0,0
SSP Group	128 559	4 428	0,0	EUZ	2 881	1 235	0,0
Synthomer	71 229	713	0,0	Evotec	28 027	6 807	0,1
Tate & Lyle	72 193	7 197	0,1	Fielmann	6 867	3 949	0,0
Telecom Plus	4 912	1 140	0,0	Fraport	6 755	3 889	0,0
THG Plc	209 793	2 348	0,0	Fuchs Petrolub Pref	12 909	5 510	0,0
Trainline	91 682	3 286	0,0	GEA Group	24 329	10 983	0,1
Travis Perkins	34 663	3 867	0,0	Gerresheimer	5 954	7 234	0,1
Tritax Big Box REIT	503 597	8 644	0,1	Grenke N	4 806	1 512	0,0
Tronox Holdings	19 500	2 677	0,0	Hella	8 250	7 010	0,1
Unite Group	73 803	8 817	0,1	HelloFresh	32 359	8 618	0,1
Vesuvius	21 804	1 193	0,0	Hugo Boss	9 837	8 293	0,1
Victrex	22 510	4 303	0,0	Jungheinrich Pref	5 341	2 111	0,0
Volution Group	23 161	1 203	0,0	K&S	30 406	5 717	0,0
Watches Of Switzerland Group	42 182	3 536	0,0	Kion Group	9 550	4 148	0,0
WH Smith	28 986	6 162	0,0	Krones	3 240	4 242	0,0
Wood Group	52 354	973	0,0	Lanxess	14 867	4 835	0,0
Workspace Group REIT	29 392	1 908	0,0	LEG Immobilien	13 484	8 364	0,1
YouGov	4 921	676	0,0	Metro	19 785	1 735	0,0
		<b>625 421</b>	<b>4,8</b>	Nagarro N	312	293	0,0
<b>SVERIGE</b>				Nemetschek	9 929	8 031	0,1
AddLife	18 691	2 275	0,0	Nordex	30 863	4 046	0,0
AddNode Group B	10 702	894	0,0	PNE Wind	4 734	790	0,0
AFRY	13 999	2 229	0,0	ProSiebenSat.1 Media	25 709	2 588	0,0
Arjo B	37 394	1 461	0,0	Rational	791	6 180	0,0
Atrium Ljungberg	16 142	3 012	0,0	Scout24	12 771	8 741	0,1
Bilia A	12 431	1 397	0,0	Siltronic N	3 397	2 802	0,0
Billerud	43 206	3 541	0,0	Sixt	3 273	4 231	0,0
BioArctic B	8 517	2 402	0,0	Sma SolarTech	3 840	5 064	0,0
Biotage	13 914	1 867	0,0	Software	9 762	3 665	0,0
Boozt	18 351	2 211	0,0	Stroer Media	4 806	2 520	0,0
Bravida	40 269	4 172	0,0	Südzucker	17 506	3 369	0,0
Bufab	5 290	1 951	0,0	Tag Immobilien	31 177	3 182	0,0
Bure Equity	5 600	1 403	0,0	TeamViewer I	29 171	5 057	0,0
Camurus	8 233	2 294	0,0	Traton	9 601	2 218	0,0
Catena	2 044	807	0,0	TUI N	75 066	5 760	0,0
Cloetta B	131 756	2 584	0,0	United Internet	19 077	2 900	0,0
Corem Property B	89 006	451	0,0	Varta	5 039	1 114	0,0
Dometic Group	63 828	4 532	0,0	Verbio	2 940	1 277	0,0
Electrolux Professional	37 497	2 194	0,0	Vitesco Technolog Group	3 016	2 682	0,0
Fortnox	76 170	4 851	0,0	Wacker Chemie	3 161	4 684	0,0
Gränges	15 656	1 611	0,0			<b>307 326</b>	<b>2,4</b>
Hemnet Group	10 930	2 064	0,0	<b>URUGUAY</b>			
Hexatronix Group	34 308	2 758	0,0	Arcos Dorados Holdings	12 000	1 329	0,0
Hexpol B	49 960	5 710	0,0			<b>1 329</b>	<b>0,0</b>
HMS Network	5 098	2 692	0,0	<b>USA</b>			
Hufvudstaden	31 294	4 009	0,0	10x Genomics A	14 900	8 987	0,1
Instalco	31 315	1 686	0,0	1st Source	4 451	2 016	0,0
Intrum Justitia	14 768	1 033	0,0	23andMe Holding A	101 600	1 920	0,0
JM	17 760	2 552	0,0	3D Systems	20 869	2 238	0,0
Lagercrantz Group	26 416	3 672	0,0	Aaon	7 416	7 595	0,1
Lindab International	5 438	834	0,0	Abercrombie & Fitch	12 600	5 128	0,0
Loomis	12 160	3 826	0,0	ABM Industries	12 909	5 947	0,0
Medicover B	2 183	357	0,0	Academy Sports and Outdoors	17 900	10 450	0,1
Mips	5 059	2 703	0,0	Acadia Healthcare	12 274	10 558	0,1
Modern Times Group MTG B	17 281	1 188	0,0	Acadia Pharmaceuticals	30 933	8 002	0,1
Munters Group B	28 641	3 503	0,0	Acadia Realty Trust REIT	19 132	2 974	0,0
Mycronic	15 546	4 151	0,0	Accolade	14 600	2 124	0,0
NCAB Group	18 657	1 568	0,0	ACI Worldwide	16 597	4 154	0,0
NCC B	19 124	1 802	0,0	Acuity Brands	3 400	5 989	0,0
New Wave B	30 438	2 887	0,0	Acushnet Holdings	7 500	4 430	0,0
Nolato B	53 040	2 689	0,0	ACV Auctions A	19 900	3 712	0,0
Nordnet	27 185	3 923	0,0	AdaptHealth	19 200	2 524	0,0
Nyfos	27 555	1 642	0,0	Adaptive Biotech	37 100	2 689	0,0
Oatly Group ADS	53 000	1 174	0,0	Addus HomeCare	2 883	2 887	0,0
OX2	11 264	821	0,0	Adela	18 900	2 248	0,0
Pandox B	21 608	2 714	0,0	ADT	113 100	7 366	0,1
Peab B	42 979	1 841	0,0	Adtalem Global Education	9 595	3 559	0,0
Ratos B	64 537	1 950	0,0	Adtran Holdings	6 500	739	0,0
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden B	156 188	646	0,0	Advance Auto Parts	8 000	6 075	0,0
Scandic Hotels Group	48 036	2 100	0,0	Advanced Drainage Systems	12 400	15 239	0,1
Sdiptech	6 552	1 751	0,0	Advanced Energy Industries	6 737	8 110	0,1
Sectra	20 282	3 669	0,0	Affiliated Managers Group	8 500	13 762	0,1
Sinch	70 199	1 709	0,0	Affirm Holdings A	28 700	4 752	0,0
Stillfront Group	20 454	369	0,0	Agco	8 700	12 350	0,1
Storskogen Group B	237 846	2 343	0,0	Agilisys	2 700	2 002	0,0
Truecaller B	22 040	652	0,0	Agilitti	5 300	945	0,0
Viaplay Group B	14 424	891	0,0	Agilon Health	32 600	6 106	0,0
Vitec Software Group	3 562	1 931	0,0	Agios Pharmaceuticals	9 123	2 791	0,0
Wilborgs Fastigheter	52 885	4 125	0,0	AGNC	82 500	9 027	0,1
		<b>134 071</b>	<b>1,0</b>	Agree Realty REIT	18 337	12 951	0,1
<b>TYSKLAND</b>				Air Lease A	14 953	6 759	0,1
1&1 Drillisch	6 848	813	0,0	Air Transport Services Group	9 900	2 018	0,0
Aixtron	23 988	8 789	0,1	Akero Therape	9 500	4 791	0,0
Alstria Office	47 522	2 806	0,0	Alamo Group	579	1 150	0,0

Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusenl	Marknads- värde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusenl	Marknads- värde ISEK	% av fondförm.
Alarm.com Holdings	6 000	3 349	0,0	Beam Therapeutics	10 500	3 621	0,0
Alaska Air Group	16 800	9 650	0,1	Beauty Health	12 491	1 129	0,0
Albertsons A	32 992	7 776	0,1	Belden	8 030	8 296	0,1
Alcoa	21 100	7 733	0,1	BellRing Brands	22 080	8 729	0,1
Alexander & Baldwin	12 303	2 469	0,0	Bentley Systems B	33 100	19 388	0,2
Alight A	32 800	3 274	0,0	Berry Global Group	17 960	12 481	0,1
Alignment Healthcare	14 700	913	0,0	Beyond Meat	9 400	1 318	0,0
Alkami Technology	6 000	1 062	0,0	BILL Holdings	16 100	20 320	0,2
Alegiant Trave	2 100	2 864	0,0	Bio Rad Laboratories A	4 372	17 903	0,1
Allegro Microsystems	17 200	8 386	0,1	Bio Techne	33 848	29 844	0,2
Alphatec Holdings	19 900	3 865	0,0	BioCryst Pharmaceuticals	35 500	2 699	0,0
Altair Engineering A	6 400	5 243	0,0	Black Knight	23 032	14 859	0,1
Alteryx A	11 100	5 443	0,0	Blackbaud	5 930	4 559	0,0
Altice USA A	11 900	388	0,0	Blackline	9 500	5 523	0,0
AMC Entertainment Holdings A	84 200	4 002	0,0	Blackstone Mortgage Trust A	23 051	5 181	0,0
AMC Network	4 302	555	0,0	Blue Owl Capital A	55 200	6 946	0,1
Amedisys	4 051	4 001	0,0	Blueprint Medicines	13 151	8 977	0,1
Ameresco	6 200	3 257	0,0	Boise Cascade	2 900	2 830	0,0
American Airlines	103 200	19 998	0,2	BOK Financial	5 272	4 600	0,0
American Assets Trust REIT	11 102	2 302	0,0	Boji Barn Holdings	6 000	5 489	0,0
American Axle & Manufacturing Hldg	15 546	1 389	0,0	BorgWarner	41 931	22 152	0,2
American Eagle Outfitters	21 792	2 778	0,0	Boston Properties	21 300	13 250	0,1
American Equity Investment Life Hldg	13 967	7 861	0,1	Box A	26 353	8 363	0,1
American Financial Group	13 500	17 316	0,1	Brady A	11 609	5 965	0,0
American Homes 4 Rent REIT A	52 992	20 291	0,2	Braze A	5 100	2 412	0,0
American Sts Water	7 900	7 424	0,1	Bread Financial Holdings	8 000	2 712	0,0
Americold Realty Trust	44 600	15 560	0,1	BridgeBio Pharma	23 750	4 412	0,0
Ameris Bancorp	12 030	4 445	0,0	Bright Horizons Family Solutions	8 344	8 332	0,1
Amerisafe	4 558	2 625	0,0	Brighthouse Financia	12 700	6 495	0,1
Amicus Therapeutics	45 341	6 151	0,0	BrightSphere Investment Group	3 000	679	0,0
Amkor Technology	17 376	5 584	0,0	Brink's	9 137	6 694	0,1
AMN Healthcare	9 816	11 570	0,1	Brixmor Property Group	66 900	15 660	0,1
Ampostar Pharmaceuticals	9 100	5 649	0,0	Broadstone Net Leas	28 800	4 803	0,0
Amylyx Pharmaceuticals	6 700	1 561	0,0	Brookfield Renewable	29 100	9 927	0,1
Andersons	823	410	0,0	Brookline Bancorp	20 583	1 943	0,0
Annaly Capita	68 100	14 719	0,1	Brown & Brown	47 934	35 642	0,3
Apartment Income REIT	33 800	13 176	0,1	BRP Group A	12 500	3 346	0,0
Apellis Pharmaceuticals	17 200	16 925	0,1	Bruker	15 900	12 695	0,1
API Group	36 000	10 600	0,1	Brunswick	10 700	10 013	0,1
Apogee Enterprises	3 944	2 022	0,0	Buckle	6 900	2 579	0,0
Apollo Commercial REIT	25 102	3 069	0,0	Builders FirstSource	23 619	34 696	0,3
Apollo Medical Holdings	7 200	2 458	0,0	Bumble A	12 400	2 247	0,0
AppFolio A	2 600	4 834	0,0	Bunge	21 000	21 401	0,2
Appian A	6 800	3 496	0,0	Cable One	993	7 048	0,1
Apple Hospitality REIT	51 718	8 441	0,1	Cabot	4 709	3 402	0,0
Applied Industrial Technologies	6 423	10 048	0,1	Cadence Bank	33 158	7 034	0,1
AppLovin A	19 500	5 419	0,0	Cal Maine Foods	7 437	3 615	0,0
APT Inv't & Mgmt A	26 648	2 452	0,0	California Water Service Group	9 316	5 195	0,0
AptarGroup	9 530	11 926	0,1	Calix Networks	13 200	7 116	0,1
Aramark	35 400	16 461	0,1	Camden Property Trust	20 800	24 460	0,2
Arbor Realty Trust REIT	29 800	4 770	0,0	Camping World Holdings A	9 900	3 219	0,0
ArcBest	5 700	6 083	0,0	Capitol Federal Financial	27 948	1 863	0,0
Arconic	12 600	4 026	0,0	CareTrust REIT	15 746	3 378	0,0
Arcosa	8 500	6 957	0,1	CarGurus A	7 400	1 809	0,0
Arcus Biosciences	8 700	1 909	0,0	Carlisle	10 409	28 842	0,2
Ares Management A	22 400	23 312	0,2	Carlyle Group	30 700	10 595	0,1
Armstrong World Industries	7 930	6 292	0,0	Carpenter Technology	2 100	1 273	0,0
Array Technologies	31 200	7 616	0,1	Carters	6 030	4 729	0,0
Arrow Electronics	12 100	18 720	0,1	Carvana A	17 100	4 787	0,0
Arrowhead Pharmaceuticals	20 100	7 742	0,1	Casella Waste Systems A	6 800	6 643	0,1
Artisan Partners Asset Mgmt A	11 923	5 062	0,0	Cassava Sciences	9 800	2 596	0,0
Arvinas	6 325	1 696	0,0	Catalyst Pharma	14 500	2 105	0,0
Asana A	14 300	3 404	0,0	Cathay General Bancorp	11 988	4 168	0,0
Asbury Automotive Group	4 051	10 520	0,1	Cavco Industries	1 986	6 328	0,0
Asgn	8 023	6 554	0,1	CBIZ	11 100	6 388	0,0
Ashland	12 400	11 640	0,1	CCC Intelligent Solutions Holdings	1 900	230	0,0
Associated Bancorp	26 962	4 727	0,0	Celldex Therapeutics	5 800	2 126	0,0
Assurant	9 300	12 629	0,1	Celsius Holdings	8 300	13 375	0,1
Astec Industrie	1 451	712	0,0	Central Garden and Pet	10 316	4 320	0,0
Atkore	7 600	12 801	0,1	Century Communities	6 100	5 048	0,0
Atlantic Union Bankshares	20 716	5 807	0,0	Cerence	7 100	2 242	0,0
AtriCure	11 700	6 238	0,0	Cerevel Therapeutics Holding	11 600	3 983	0,0
Autoliv SDB	17 700	16 258	0,1	Ceridian HCM Holding	22 200	16 059	0,1
AutoNation	6 100	10 846	0,1	Certara	14 800	2 911	0,0
Avanos Medical	8 216	2 268	0,0	CF Industries Holdings	31 000	23 245	0,2
Avery Dennison	19 800	36 742	0,3	ChargePoint Holdings A	42 000	3 988	0,0
Avid Technology	4 000	1 102	0,0	Charles River Laboratories International	7 837	17 798	0,1
Avidxchange Holdings	11 100	1 245	0,0	Chart Industries	7 044	12 158	0,1
Avient	16 381	7 237	0,1	Chegg	19 532	1 873	0,0
Avis Budget Group	3 788	9 356	0,1	Chemed	2 372	13 878	0,1
Avnet	18 400	10 027	0,1	Chemours	4 700	1 873	0,0
Axalta Coating Systems	45 300	16 054	0,1	Chimera Investment	52 462	3 270	0,0
Axcelis Technologies	6 800	13 465	0,1	Choice Hotels International	6 551	8 316	0,1
Axon Enterprise	13 002	27 402	0,2	Ciena	29 362	13 476	0,1
Axonics	7 500	4 089	0,0	Cinemark Holdings	21 832	3 891	0,0
Axos Financia	9 995	4 258	0,0	Cirrus Logic	9 495	8 308	0,1
Axsome Therapeutics	6 200	4 812	0,0	City Holding	3 751	3 646	0,0
Azek A	20 600	6 740	0,1	Claros Mortgage Trust	13 000	1 592	0,0
Azenta	14 381	7 251	0,1	Clean Harbors	9 709	17 244	0,1
AZZ	1 637	768	0,0	Clear Secure A	7 700	1 927	0,0
B&G Foods	11 388	1 712	0,0	CNO Financial Group	23 055	5 894	0,0
Badger Meter	5 344	8 517	0,1	Coca-Cola Consolidated	733	5 036	0,0
Balchem	5 651	8 229	0,1	Coeur Mining	70 029	2 148	0,0
BancFirst	3 758	3 734	0,0	Cogent Communications	4 830	3 511	0,0
Bancorp	11 500	4 056	0,0	Cognex	27 400	16 579	0,1
Bank of Hawaii	9 937	4 425	0,0	Cohen & Steers	5 251	3 289	0,0
Bank OZK	20 825	9 033	0,1	Cohu	13 300	5 970	0,0
BankUnited	17 232	4 011	0,0	Columbia Banking System	39 921	8 745	0,1
Banner	5 544	2 615	0,0	Columbia Financial	300	56	0,0
Barnes Group	11 300	5 149	0,0	Columbia Sportswear	7 858	6 556	0,1
Bath And Body Works	46 549	18 855	0,1	Comerica	20 600	9 425	0,1
Beacon Roofing Supply	12 295	11 020	0,1	Comfort Systems USA	6 237	11 062	0,1

Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
Commerce Bancshares	21 265	11 186	0,1	EQRx	102 300	2 055	0,0
Commercial Metals	14 500	8 248	0,1	Equitable Holdings	68 200	20 007	0,2
CommScope	43 900	2 670	0,0	Equity Commonwealth REIT	20 923	4 579	0,0
Community Bank System	9 916	5 021	0,0	Equity Lifestyle Properties REIT	32 618	23 566	0,2
CommVault Systems	6 630	5 201	0,0	Erie Indemnity A	3 965	8 994	0,1
Compass A	17 200	650	0,0	ESAB	6 800	4 887	0,0
Compass Minerals	8 937	3 282	0,0	Essential Properties Realty	21 200	5 390	0,0
Compass SBI	8 800	2 062	0,0	Euronet Worldwide	9 830	12 462	0,1
Concentrix	6 300	5 495	0,0	European Wax Center A	7 100	1 429	0,0
Confluent A	25 300	9 649	0,1	Everbridge	7 000	2 034	0,0
Conmed	5 323	7 813	0,1	Evercore A	5 237	6 991	0,1
Construction Partners A	8 800	2 984	0,0	EVgo Fg	9 600	415	0,0
COPT REIT	19 681	5 049	0,0	Evoleant Health A	14 900	4 876	0,0
Corcept Therapeutics	17 881	4 297	0,0	Exact Sciences	29 700	30 123	0,2
Core & Main A	16 700	5 653	0,0	Exelixis	55 166	11 387	0,1
CoreCivic	21 300	2 165	0,0	ExlService Holdings	4 358	7 111	0,1
Corsair Gaming	8 100	1 552	0,0	eXp World Holdings	15 800	3 461	0,0
CorVel	1 600	3 344	0,0	Exponent	8 200	8 265	0,1
Coty A	71 100	9 438	0,1	Extreme Networks	18 200	5 121	0,0
Coursera	12 000	1 688	0,0	F5	8 000	12 638	0,1
Cousins Properties REIT	47 620	11 727	0,1	Factset Research Systems	7 351	31 812	0,2
Cracker Barrel Old Country Store	4 872	4 903	0,0	Fastly A	16 500	2 811	0,0
Credit Acceptance	1 386	7 604	0,1	Federal Realty Investment Trust	15 500	16 201	0,1
Crocs	11 200	13 602	0,1	Federal Signal	4 060	2 808	0,0
Crown Holdings	19 000	17 828	0,1	Federated Hermes	17 953	6 952	0,1
CryoPort	8 100	1 509	0,0	FibroGen	18 088	528	0,0
CSG Systems International	6 930	3 948	0,0	Figs A	23 100	2 063	0,0
CSW Industrials	2 700	4 847	0,0	First American Financial	15 160	9 337	0,1
CTS Corp	2 400	1 105	0,0	First Bancorp	6 844	2 199	0,0
CubeSmart REIT	48 334	23 316	0,2	First Busey	11 695	2 539	0,0
Cullen/Frost Bankers	10 916	12 679	0,1	First Citizens Bancshares A	1 772	24 565	0,2
CVB Financial	21 811	3 129	0,0	First Financial Bancorp	15 884	3 507	0,0
Cytek Biosciences	16 800	1 550	0,0	First Financial Bankshares	25 618	7 883	0,1
Cytokinetics	17 400	6 131	0,0	First Hawaiian	34 409	6 694	0,1
Dana	20 690	3 799	0,0	First Horizon	85 319	10 386	0,1
Darling Ingredients	29 234	20 143	0,2	First Industrial Realty Trust	21 974	12 494	0,1
Davita	6 600	7 162	0,1	First Interstate BancSystem A	21 853	5 627	0,0
Day One Biopharmaceuticals	6 500	838	0,0	First Merchants	13 516	4 121	0,0
Deckers Outdoor	4 844	27 608	0,2	First Solar	16 781	34 455	0,3
Denali Therapeutics	17 200	5 482	0,0	FirstCash Holdings	6 316	6 367	0,0
Dentsply Sirona	42 200	18 242	0,1	Fisker A	34 600	2 108	0,0
Dick's Sporting Goods	9 800	13 993	0,1	Five Below	8 709	18 488	0,1
Digi International	3 900	1 659	0,0	Five9	14 695	13 087	0,1
Digital Turbine	16 800	1 684	0,0	Floor Decor Holdings A	16 500	18 528	0,1
DigitalBridge Group A	22 200	3 527	0,0	Flowers Foods	39 306	10 563	0,1
DigitalOcean Holdings	10 000	4 336	0,0	Flowserve	24 300	9 751	0,1
DineEquity	1 700	1 066	0,0	Fluence Energy A	8 900	2 561	0,0
Diodes	7 509	7 502	0,1	Flywire	11 500	3 856	0,0
Dish Network	15 600	1 110	0,0	FNB	44 731	5 527	0,0
Diversey Holdings	11 500	1 042	0,0	Focus Financial Partners A	6 600	3 743	0,0
Dolby Laboratories	9 516	8 601	0,1	Foot Locker	21 300	6 237	0,0
Donaldson	21 132	14 268	0,1	ForgeRock A	1 600	355	0,0
Dorman Products	5 144	4 380	0,0	FormFactor	12 960	4 790	0,0
DoubleVerify Holdings	13 200	5 549	0,0	Fortune Brands Innovations	22 700	17 641	0,1
Douglas Emmett REIT	47 160	6 403	0,0	Forward Air	4 737	5 429	0,0
Doximity A	15 400	5 659	0,0	Four Corners Property	13 395	3 675	0,0
Driven Brands Holdings	12 200	3 566	0,0	Fox Factory Holding	8 030	9 412	0,1
DropBox A	39 300	11 321	0,1	Franchise Group	3 700	1 145	0,0
Dun Bradstreet Holdings	51 400	6 424	0,0	Franklin Electric	7 423	8 250	0,1
Duolingo A	4 000	6 176	0,0	Freedom Holding	3 300	2 881	0,0
Dutch Bros A	4 900	1 506	0,0	Freshpet	6 900	4 905	0,0
DXC Technology	36 400	10 505	0,1	Freshworks A	14 500	2 753	0,0
Dycom Industries	5 351	6 569	0,1	Frontdoor	13 100	4 514	0,0
Dynatrace	33 200	18 457	0,1	Frontier Communications Parent	36 600	7 369	0,1
Dynavax Technologies	26 400	3 684	0,0	Frontier Group Holdings	17 700	1 849	0,0
E2open Parent Holdings A	34 200	2 069	0,0	FTAI Aviation	11 000	3 762	0,0
Eagle Bancorp	6 151	1 406	0,0	FTI Consulting New York	6 023	12 374	0,1
Eagle Materials	4 430	8 920	0,1	Fulgent Genetics	3 400	1 360	0,0
East West Bancorp	26 300	14 996	0,1	Fulton Financial	34 813	4 482	0,0
Easterly REIT	20 600	3 226	0,0	Gamestop	49 000	12 835	0,1
Eastern Bankshares	28 900	3 830	0,0	Gaming and Leisure Properties REIT	45 100	23 607	0,2
EastGroup Properties	7 358	13 797	0,1	GAP	43 200	4 167	0,0
EchoStar A	10 216	1 913	0,0	Gates Industrial	2 000	291	0,0
Ecovyst	2 500	309	0,0	GATX	5 430	7 551	0,1
Edgewell Personal Care	9 402	4 195	0,0	Generac Holding	9 500	15 303	0,1
EHC	15 653	11 448	0,1	Gentex	41 766	13 200	0,1
Elanco Animal Health	82 400	8 954	0,1	Gentherm	5 416	3 306	0,0
Element Solutions	33 615	6 971	0,1	Genworth Financial	89 290	4 822	0,0
elf Beauty	10 300	12 708	0,1	GEO Group REIT	21 000	1 624	0,0
Elme Communities	14 288	2 537	0,0	Getty Realty REIT	6 716	2 453	0,0
Embecta	8 500	1 983	0,0	GHC	693	4 278	0,0
Emcor Group	9 616	19 192	0,1	Gibraltar Industries	6 109	4 152	0,0
Empire State Realty REIT A	43 218	3 496	0,0	Gitlab A	10 900	6 017	0,0
Employers Holdings	5 737	2 318	0,0	Glacier Bancorp	25 374	8 543	0,1
Encore Capital Group	4 944	2 596	0,0	Glaukos	10 300	7 922	0,1
Encore Wire	3 537	7 103	0,1	Global Net Lease	19 146	2 126	0,0
Endeavor Group Holdings A	24 100	6 227	0,0	Globus Medical A	14 060	9 042	0,1
Energizer Holdings	10 988	3 985	0,0	GMS	9 437	7 054	0,1
Enerpac Tool Group A	12 574	3 667	0,0	Godaddy A	29 600	24 020	0,2
EnerSys	8 030	9 412	0,1	Gogo	13 200	2 425	0,0
Enova International	3 600	2 066	0,0	Goodyear Tire & Rubber	9 100	1 345	0,0
Enovis	7 117	4 929	0,0	Goosehead Insurance A	3 300	2 242	0,0
Enovix	19 300	3 761	0,0	Graco	25 390	23 681	0,2
ENPRO Industries	4 200	6 058	0,0	GrafTech International	31 800	1 731	0,0
Ensign Group	6 567	6 771	0,1	Grand Canyon Education	5 830	6 499	0,1
Entegris	27 926	33 427	0,3	Granite Construction	5 937	2 551	0,0
Enterprise Financial Services	7 837	3 310	0,0	Graphic Packaging Holding	47 052	12 213	0,1
Ervestnet	6 923	4 438	0,0	Gray Television	14 560	1 239	0,0
Envista Holdings	25 600	9 357	0,1	Green Dot A	7 337	1 485	0,0
Enviva	8 500	996	0,0	Green Plains	7 100	2 472	0,0
ePlus	5 644	3 432	0,0	Greif A	5 151	3 833	0,0
EPR Properties REIT	13 200	6 673	0,1	Grid Dynamics Holdings A	1 900	190	0,0



Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
Griffon	9 900	4 309	0,0	Jamf Holding	14 100	2 973	0,0
Group 1 Automotive	2 858	7 968	0,1	Janus International	4 700	541	0,0
Guardant Health	16 100	6 226	0,0	JBG SMITH Properties	25 600	4 159	0,0
Guess	12 374	2 600	0,0	Jefferies Financial Group	39 203	14 046	0,1
Guidewire Software	16 995	13 966	0,1	JELD WEN Holding	10 500	1 989	0,0
GXO Logistics	18 200	12 349	0,1	JetBlue Airways	40 600	3 885	0,0
H & R Block	28 700	9 880	0,1	JFrog	14 200	4 249	0,0
H&E Equipment Services	5 637	2 786	0,0	John B Sanfilippo and Son	300	380	0,0
Haemonetics	9 395	8 640	0,1	John Bean Technologies	5 151	6 749	0,1
Hain Celestial Group	11 739	1 586	0,0	John Wiley and Sons A	6 537	2 403	0,0
Halozyne Therapeutics	22 069	8 598	0,1	Jones Lang LaSalle	7 418	12 483	0,1
Hamilton Lane A	6 500	5 615	0,0	Juniper Networks	64 600	21 861	0,2
Hancock Whitney	14 974	6 208	0,0	Kadant	2 779	6 667	0,1
Hanesbrands	60 553	2 969	0,0	Kaiser Alum	300	232	0,0
Hannon Armstrong	18 188	4 911	0,0	Karuna Therap	5 100	11 946	0,1
Hanover Insurance Group	6 737	8 225	0,1	KB Home	14 274	7 973	0,1
Harley-Davidson	22 423	8 528	0,1	Kemper	8 773	4 573	0,0
Harmonic	15 200	2 655	0,0	Kennametal	14 774	4 530	0,0
Harmony Bioscienc	8 100	3 079	0,0	Kennedy Wilson Holdings	26 576	4 688	0,0
Hayward Holdings	32 400	4 497	0,0	Keros Therapeutics	6 700	2 908	0,0
HB Fuller	12 216	9 436	0,1	Kiroy Realty REIT	25 474	8 279	0,1
Healthcare Realty Trust	57 536	11 721	0,1	Kimco Realty	115 742	24 653	0,2
Healthcare Services	895	144	0,0	Kinsale Capital Group	3 200	12 934	0,1
Healthequity	15 216	10 377	0,1	Kirby	10 700	8 893	0,1
Heartland Express	11 816	2 094	0,0	Kite Realty Group Trust REIT	57 933	13 979	0,1
Heartland Financial USA	9 537	2 871	0,0	Knight-Swift Transportation Hldg	29 300	17 584	0,1
Hecla Mining	101 316	5 636	0,0	Knowles	13 590	2 651	0,0
Helios Technologies	6 858	4 896	0,0	Kohl's	19 794	4 928	0,0
Herc Holdings	4 858	7 181	0,1	Kontoor Brands	13 292	6 044	0,0
Hertz Global Holding	39 600	7 866	0,1	Korn Ferry	9 702	5 192	0,0
Hexcel	12 474	10 243	0,1	Krispy Kreme	5 200	827	0,0
Hibbett Sports	400	157	0,0	Krystal Biotech	5 200	6 594	0,1
Highwoods Properties REIT	16 223	4 190	0,0	Kymera Therapeutics	10 600	2 632	0,0
Hillenbrand	13 897	7 697	0,1	Kyndryl Holdings	28 600	4 102	0,0
Hillman Solutions	34 900	3 396	0,0	La-Z-Boy	11 202	3 465	0,0
Hilltop Holdings	12 946	4 399	0,0	Ladder Capital A	27 300	3 199	0,0
Hilton Grand Vacations	12 109	5 943	0,0	Lakeland Financial	5 030	2 636	0,0
Hims & Hers Health A	26 800	2 721	0,0	Lamar Advertising A	14 881	15 953	0,1
HNI	7 816	2 379	0,0	Lamb Weston Holdings	26 600	33 027	0,3
Home BancShares	29 255	7 205	0,1	Lancaster Colony	3 472	7 541	0,1
Hope Bancorp	20 969	1 907	0,0	Landstar System	6 644	13 817	0,1
Horace Mann Educators	7 830	2 508	0,0	Lantheus Holdings	12 800	11 602	0,1
Hostess Brands A	22 600	6 181	0,0	Lattice Semiconductor	26 700	27 706	0,2
Houlihan Lokey A	8 158	8 663	0,1	Laureate Education A	8 400	1 097	0,0
Howard Hughes	8 258	7 039	0,1	LCI Industries	3 758	5 129	0,0
Hub Group A	4 744	4 116	0,0	Lear	10 700	16 591	0,1
Hubbell	9 423	33 746	0,3	LegalZoom	13 400	1 748	0,0
Hudson Pacific Properties REIT	29 918	1 364	0,0	Legend Biotech	27 300	20 355	0,2
Huntsman	31 513	9 197	0,1	Leggett & Platt	25 700	8 222	0,1
Huron Consulting Group	3 400	3 118	0,0	Lemonade	6 200	1 128	0,0
Hyatt Hotels A	7 500	9 282	0,1	Lennox Intl	4 800	16 906	0,1
IAC	10 400	7 055	0,1	Leslie's	25 600	2 596	0,0
ICF International	2 944	3 955	0,0	Levi Strauss A	8 600	1 340	0,0
Ichor Holdings	8 000	3 240	0,0	LGI Homes	3 265	4 757	0,0
ICU Medical	3 772	7 260	0,1	Liberty Braves C	11 560	4 947	0,0
IDEX	15 800	36 736	0,3	Liberty Media	38 600	31 387	0,2
ImmunoGen	35 000	7 134	0,1	Liberty Media A	15 600	5 528	0,0
IMPINJ	3 900	3 777	0,0	Liberty Media C	30 800	10 889	0,1
Inari Medica	7 500	4 710	0,0	Life Storage	14 045	20 171	0,2
Independence Realty	48 761	9 596	0,1	Lifestance Health Group	2 300	227	0,0
Independent Bank	10 629	5 110	0,0	Ligand Pharmaceuticals	3 658	2 849	0,0
Independent Bank Group	7 900	2 946	0,0	Lincoln Electric Holdings	11 216	24 064	0,2
Indie Semiconductor A	16 700	1 696	0,0	Lincoln National	26 800	7 457	0,1
Infinera	42 306	2 207	0,0	Lindsay	2 872	3 702	0,0
Informatica	12 800	2 558	0,0	Lions Gate Entertainment A	33 218	3 168	0,0
Ingevity	7 637	4 798	0,0	Lithia Motors A	5 258	17 271	0,1
Ingredion	15 130	17 315	0,1	Littelfuse	3 465	10 903	0,1
Innoviva	14 476	1 990	0,0	Live Oak Bancshares	6 900	1 961	0,0
Insight Enterprises	2 630	4 157	0,0	Livent	32 300	9 570	0,1
Insmid	27 881	6 354	0,0	LiveRamp	13 567	4 185	0,0
Insperty	5 044	6 481	0,1	Louisiana Pacific	14 176	11 481	0,1
Inspire Medical Systems	5 500	19 286	0,1	LPL Financial Holdings	14 081	33 070	0,3
Installed Building Products	3 665	5 548	0,0	LTC Properties REIT	9 430	3 363	0,0
Insulet	12 216	38 046	0,3	Lumen Technologies	110 700	2 702	0,0
IntApp	3 700	1 675	0,0	Lumentum Holdings	14 347	8 791	0,1
Integer Holdings	5 737	5 491	0,0	Luminar Technologies A	50 000	3 716	0,0
Integra LifeSciences Holdings	9 302	4 132	0,0	LXP Industrial Trust	79 215	8 342	0,1
Integral Ad Science Holding	5 700	1 107	0,0	Lyft	49 000	5 076	0,0
Intellia Therapeutics	13 600	5 990	0,0	M I Homes	4 600	4 332	0,0
Inter Parfums	4 300	6 281	0,0	Macerich	60 556	7 372	0,1
InterDigital	6 330	6 601	0,1	Macy's	50 865	8 818	0,1
International Bancshare	15 502	7 401	0,1	Madison Square Garden	5 800	2 106	0,0
Interpublic Group	69 000	28 753	0,2	Madison Square Garden Sports A	2 872	5 834	0,0
Intra Cellular Therapies	15 400	10 533	0,1	Madrigal Pharmaceuticals	2 800	6 986	0,1
InvenTrust Properties	6 200	1 550	0,0	Magnit	23 500	3 465	0,0
Invesco	68 800	12 492	0,1	Malibu Boats A	4 900	3 105	0,0
IonQ	22 200	3 244	0,0	Manhattan Assoc	10 788	23 291	0,2
Iovance Biotherapeutics	29 200	2 220	0,0	ManpowerGroup	10 400	8 919	0,1
IPG Photonics	5 900	8 655	0,1	Marathon Digital Holdings	20 300	3 039	0,0
iRhythm Technologies	5 300	5 972	0,0	Maravai LifeSciences Holdings A	22 100	2 967	0,0
iRobot	6 058	2 961	0,0	Marcus & Millichap	5 800	1 974	0,0
Ironwood Pharma A	28 955	3 328	0,0	MarketAxess Holdings	6 644	18 761	0,1
ISIS Pharmaceuticals	30 711	13 610	0,1	Marqeta A	73 500	3 866	0,0
Itron	6 944	5 408	0,0	Marriott Vacation Worldwide	7 177	9 513	0,1
ITT	13 600	13 692	0,1	Marten Transport	11 700	2 717	0,0
Iveric Bio	25 700	10 921	0,1	Masimo	8 830	15 694	0,1
J&J Snack Foods	2 479	4 240	0,0	Masonite	3 844	4 253	0,0
Jabil Circuit	20 348	23 721	0,2	MasTec	12 100	15 418	0,1
Jack Henry and Associates	14 600	26 388	0,2	Materion	2 100	2 590	0,0
Jack In The Box	3 351	3 530	0,0	Matson	6 200	5 205	0,0
Jackson Financial A	13 600	4 497	0,0	Mattel	54 700	11 545	0,1
JAI	41 800	4 632	0,0	Matthews International A	7 330	3 374	0,0

Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
Maximus	9 916	9 052	0,1	Owens Corning	18 200	25 654	0,2
MaxLinear	20 081	6 858	0,1	Oxford Industries	3 326	3 536	0,0
McGrath Rent	4 258	4 253	0,0	Pacific Premier Bancorp	16 823	3 758	0,0
MDC Holdings	11 743	5 932	0,0	Pacific Biosciences of California	36 100	5 186	0,0
Medical Prop REIT	99 752	9 977	0,1	Pacira BioSciences	9 623	4 165	0,0
Medifast	2 000	1 991	0,0	Pactiv Evergreen	8 900	728	0,0
Medpace Holdings	4 700	12 192	0,1	PacWest Bancorp	19 511	1 718	0,0
Mercury General	4 358	1 425	0,0	PagerDuty	16 900	4 104	0,0
Merit Medical Systems	10 509	9 494	0,1	Palomar Holdings	4 000	2 508	0,0
Meritage Homes	7 423	11 407	0,1	Papa Johns International	5 851	4 666	0,0
Mesa Laboratories	800	1 110	0,0	Paragon 28	14 200	2 721	0,0
Methode Electronics	8 237	2 982	0,0	Paramount Group REIT	42 020	2 011	0,0
MFA Financial REIT	23 847	2 895	0,0	Park National	2 965	3 277	0,0
MGIC Investment	49 382	8 422	0,1	Pathward Financia	4 500	2 253	0,0
MicroStrategy A	1 486	5 496	0,0	Patrick Industries	6 008	5 192	0,0
Middleby	8 000	12 774	0,1	Patterson	13 400	4 814	0,0
Middlesex Water	3 700	3 224	0,0	Paycor HCM	6 200	1 585	0,0
MillerKnoll	11 377	1 816	0,0	Paylocity Holding	6 351	12 659	0,1
Minerals Technologies	6 637	4 136	0,0	Payoneer Global	21 600	1 122	0,0
Mirati Ther	8 900	3 473	0,0	PDF Solutions	4 300	2 095	0,0
Mirion Technologies A	43 500	3 970	0,0	Pediatrix Medical Group	15 800	2 425	0,0
Mister Car Wash	5 000	521	0,0	Pegasystems	6 144	3 272	0,0
Model N	1 200	458	0,0	Peloton Intera A	55 700	4 627	0,0
Modivcare	2 800	1 367	0,0	PennyMac Financial Services	5 300	4 025	0,0
Moelis A	11 751	5 755	0,0	PennyMac Mortgage Investment Trust	19 511	2 841	0,0
Mohawk Industries	9 211	10 263	0,1	Penske Auto Group	5 116	9 208	0,1
Molina Healthcare	10 137	32 984	0,3	Penumbra	6 658	24 743	0,2
Monolithic Power Systems	7 444	43 437	0,3	Perdoceo Education	14 300	1 895	0,0
Monro	8 037	3 527	0,0	Perficient	5 212	4 691	0,0
Montauk Renewables	20 900	1 680	0,0	Petco Health and Wellness A	25 600	2 461	0,0
Montrose Environmental Group	3 800	1 729	0,0	PGT Innovations	15 000	4 723	0,0
Morningstar	3 372	7 141	0,1	Phillips Edison	24 500	9 019	0,1
Morphic Holding	5 300	3 282	0,0	Phreesia	6 800	2 278	0,0
MP Materials A	23 700	5 857	0,0	Physicians Realty Trust REIT	47 162	7 127	0,1
Mr Cooper Group	12 100	6 618	0,1	Piedmont Office Realty Trust REIT	26 618	2 090	0,0
MSA Safety	7 344	13 799	0,1	Pilgrims Pride	7 100	1 648	0,0
MSC Industrial A	14 630	15 056	0,1	Pinnacle Financial Partners	14 695	8 992	0,1
Mueller Industries	10 174	9 591	0,1	Piper Sandler	3 772	5 266	0,0
Mueller Water Products A	29 736	5 213	0,0	PJT Partners A	2 600	1 956	0,0
MYR Group	2 800	4 184	0,0	Planet Fitness A	13 481	9 820	0,1
Myriad Genetics	14 488	3 627	0,0	Planet Labs PBC A	45 800	1 593	0,0
Natera	16 300	8 567	0,1	Plexus	5 637	5 982	0,0
National Beverage	6 258	3 268	0,0	Plug Power	95 500	10 718	0,1
National Health Investors REIT	12 951	7 333	0,1	Polaris Industries	9 000	11 756	0,1
National Instruments	20 760	12 871	0,1	Pool	6 044	24 458	0,2
National Storage Affiliates	14 516	5 461	0,0	Portillo's A	800	195	0,0
National Vision Holdings	15 000	3 935	0,0	Post Holdings	8 609	8 057	0,1
Navient	20 100	4 034	0,0	Pottlatch REIT	13 243	7 560	0,1
NBT Bancorp	9 295	3 198	0,0	Power Integrations	9 302	9 512	0,1
nCino	11 700	3 806	0,0	PowerSchool Holdings A	2 100	434	0,0
NCR	18 704	5 091	0,0	PRA Group	7 195	1 776	0,0
Nelnet A	2 351	2 450	0,0	Premier A	23 795	7 109	0,1
Neogen	30 564	7 180	0,1	Prestige Consumer Healthcare	10 781	6 921	0,1
NeoGenomics	18 600	3 229	0,0	PriceSmart	5 158	4 126	0,0
NetScout Systems	15 032	5 025	0,0	Prime Medicine	3 900	617	0,0
Neurocrine Biosciences	17 367	17 689	0,1	Primerica	9 237	19 731	0,2
Nevro	6 158	1 691	0,0	Primo Water	33 541	4 545	0,0
New Relic	8 737	6 176	0,0	Privia Health Group	10 600	2 989	0,0
New York Community Bancorp	113 447	13 773	0,1	ProAssurance	12 223	1 992	0,0
New York Mortgage Trust REIT	24 825	2 660	0,0	Procept BioRobotics	6 900	2 635	0,0
New York Times A	29 104	12 380	0,1	Procore Technologies	25 700	18 063	0,1
Newell Brands	54 500	5 121	0,0	PROG Holdings	4 800	1 665	0,0
Newmark Group A	36 217	2 433	0,0	Progress Software	7 716	4 842	0,0
Newmarket	1 700	7 384	0,1	Progyny	10 000	4 249	0,0
News	92 200	19 420	0,2	Pros Holdings	6 300	2 096	0,0
NexPoint Residential Trust	5 400	2 653	0,0	Prosperity Bancshares	13 631	8 316	0,1
Nexstar Media Group	5 930	10 668	0,1	Provident Financial Services	25 474	4 496	0,0
NextGen Healthcare	9 600	1 682	0,0	PTC	20 200	31 048	0,2
Nextracker A	4 200	1 806	0,0	PTC Therapeutics	13 300	5 843	0,0
NMI Holdings A	18 100	5 048	0,0	Pure Storage A	56 353	22 412	0,2
NNN REIT	26 200	12 109	0,1	PureCycle Technologies	15 700	1 813	0,0
Nordson	11 130	29 836	0,2	PVH	12 700	11 656	0,1
Nordstrom	21 830	4 827	0,0	Q2 Holdings	20 116	6 714	0,1
Nova	7 800	1 598	0,0	Quaker Houghton	2 679	5 640	0,0
Novanta	5 451	10 839	0,1	Qualys	4 751	6 629	0,1
Nu Skin Enterprises	6 916	2 480	0,0	QuantumScape A	42 100	3 633	0,0
Nutanix A	39 500	11 968	0,1	QuidelOrtho	10 719	9 593	0,1
NuVasive	10 716	4 814	0,0	R1 RCM	33 600	6 696	0,1
NV5 Global	1 700	2 034	0,0	Radian Group	27 585	7 532	0,1
ODP	8 500	4 299	0,0	RadNet	4 400	1 550	0,0
Olaplex Holdings	12 700	510	0,0	Ralph Lauren	9 000	11 986	0,1
Old National Bancorp	48 959	7 372	0,1	Rambus	18 597	12 890	0,1
Old Republic	45 971	12 498	0,1	Rapid7	8 800	4 304	0,0
Ollie's Bargain Outlet Holdings	9 000	5 631	0,0	Rayonier	34 439	11 680	0,1
Olo A	19 200	1 340	0,0	Ready Capital	3 100	378	0,0
Omega Healthcare Investors REIT	36 813	12 203	0,1	Reata Pharmaceuticals A	5 732	6 313	0,0
Omniceil	6 123	4 872	0,0	Recursion Pharmaceuticals A	22 400	1 807	0,0
OneMain Holdings	17 381	8 202	0,1	Redfin	17 000	2 281	0,0
Onto Innovation	9 300	11 700	0,1	Regal Rexnord	12 814	21 301	0,2
Open Lending	13 500	1 533	0,0	Regency Centers	33 500	22 351	0,2
Opendoor Technologies	81 600	3 543	0,0	Reinsurce Group of Amerika	10 200	15 280	0,1
Openlane	26 225	4 311	0,0	Relay Therapeutics	27 900	3 785	0,0
Opko Health	86 121	2 019	0,0	Reliance Steel & Aluminum	9 781	28 693	0,2
Option Care Health	26 800	9 405	0,1	Remity Global	14 000	2 846	0,0
Organon & Co	41 000	9 216	0,1	Renasant	10 223	2 885	0,0
Ormat Technologies	9 444	8 208	0,1	Repay Holdings A	11 500	973	0,0
Oscar Health A	8 100	705	0,0	Repligen	8 923	13 634	0,1
OSI Systems	3 665	4 665	0,0	Replimune Group	5 600	1 405	0,0
Outfront Media	40 583	6 891	0,1	Resideo Technologies	41 800	7 973	0,1
Outset Medical	9 000	2 126	0,0	Retail Opportunity Investments REIT	26 997	3 940	0,0
Overstock Com	7 800	2 744	0,0	Revanche Therapeutics	13 500	3 691	0,0
Owens & Minor	14 200	2 920	0,0	Revolution Medic	13 400	3 872	0,0

Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.		Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde ISEK	% av fondförm.
Revolve Group A	8 400	1 488	0,0	Starwood Property Trust REIT	66 697	13 976	0,1
Revvity	27 160	34 849	0,3	Steel Dynamics	29 400	34 592	0,3
Rexford Industrial Realty REIT	27 302	15 400	0,1	Steelcase A	21 118	1 759	0,0
Reynolds Consumer Products	13 500	4 119	0,0	Stepan	4 165	4 299	0,0
RH	2 751	9 794	0,1	StepStone Group A	5 500	1 474	0,0
Rhythm Pharmaceuticals	7 600	1 354	0,0	Stericycle	16 900	8 477	0,1
RingCentral A	10 600	3 747	0,0	Steven Madden	13 803	4 874	0,0
Riot Platforms	20 000	2 553	0,0	Stewart Info.Serv.	4 700	2 089	0,0
Rithm Capital	75 494	7 624	0,1	Stifel Financial	15 532	10 011	0,1
RLJ	7 330	10 805	0,1	StoneX Group	1 100	987	0,0
RLJ Lodging Trust REIT	31 541	3 499	0,0	Stratasys	17 000	3 261	0,0
Robert Half International	13 800	11 212	0,1	Strategic Education	3 960	2 902	0,0
Robinhood Markets A	84 800	9 141	0,1	Stride	7 700	3 096	0,0
Rocket Lab USA	29 900	1 938	0,0	Summit Materials A	9 300	3 802	0,0
Rocket Pharmaceuticals	12 300	2 640	0,0	Sun Communities REIT	22 116	31 164	0,2
Rogers	3 472	6 073	0,0	Sun Country Airlines Holdings	9 500	2 307	0,0
Roku A	19 700	13 610	0,1	Sunnova Energy International	19 400	3 837	0,0
Royal Gold	9 702	12 028	0,1	Sunpower	19 800	2 096	0,0
RPM International	22 432	21 741	0,2	Sunrun	35 000	6 752	0,1
Rush Enterprises A	9 626	6 315	0,0	Super Micro Computer	9 100	24 499	0,2
RXO	19 000	4 652	0,0	Supernus Pharmaceuticals	12 416	4 031	0,0
Ryan Specialty Holdings A	9 100	4 412	0,0	Surgery Partners	7 900	3 839	0,0
Ryder System	3 600	3 297	0,0	Sweetgreen	2 900	402	0,0
S and T Bancorp	7 216	2 119	0,0	Sylvamo	3 700	1 617	0,0
Sabra Health Care REIT	48 106	6 116	0,0	Synaptics	5 937	5 475	0,0
Sabre	61 100	2 105	0,0	Syndax Pharmaceuticals	9 000	2 035	0,0
Safehold	10 343	2 651	0,0	Syneos Health A	18 509	8 425	0,1
Safety Insurance Group	4 558	3 531	0,0	Synovus Financial	25 072	8 192	0,1
Sage Therapeutics	9 744	4 949	0,0	Tandem Diabetes Care	10 700	2 836	0,0
Saia	5 158	19 077	0,1	Tanger Factory Outlet Centers REIT	19 211	4 580	0,0
Sallie Mae	44 379	7 823	0,1	Taylor Morrison Home	21 760	11 463	0,1
Sally Beauty Holdings	25 634	3 419	0,0	TD Synnex	7 442	7 556	0,1
Samsara A	22 200	6 645	0,1	TechTarget	4 600	1 547	0,0
Sarepta Therapeutics	13 902	17 196	0,1	Tegna	37 508	6 579	0,1
Schneider National B	14 900	4 622	0,0	Teladoc Health	21 600	5 907	0,0
Scholastic	2 923	1 228	0,0	Telephone and Data Systems	18 225	1 620	0,0
Schrodinger	10 200	5 500	0,0	Tempur Sealy International	31 620	13 685	0,1
Schweitzer Mauduit Internationa	2 200	359	0,0	Tenable Holdings	19 700	9 267	0,1
Scilex Holding	11 168	672	0,0	Tenet Healthcare	16 318	14 344	0,1
Scotts Miracle-Gro	11 244	7 614	0,1	Tennant	4 765	4 175	0,0
Seacoast Banking of Florida	12 009	2 867	0,0	Teradata	15 604	9 002	0,1
Sealed Air	18 900	8 166	0,1	Terex	9 153	5 915	0,0
SeaWorld Entertainment	7 500	4 537	0,0	Terreno Realty REIT	13 030	8 459	0,1
SEI	22 000	14 167	0,1	Tetra Tech	9 609	16 995	0,1
Select Medical Holdings	16 711	5 751	0,0	Texas Capital Bancshares	8 223	4 574	0,0
Selective Insurance Group	10 016	10 380	0,1	TG Therapeutics	22 300	5 983	0,0
Semtech	20 088	5 524	0,0	Thor Industries	8 423	9 416	0,1
Sensata Technologies Holding	32 700	15 891	0,1	Thoughtworks Holding	9 900	807	0,0
Sensient Technologies	12 937	9 939	0,1	Timken	12 100	11 963	0,1
SentinelOne A	31 400	5 121	0,0	Toast A	48 600	11 848	0,1
Service Corporation International	26 648	18 591	0,1	Toll Brothers	15 200	12 982	0,1
Service Properties Trust	33 100	3 107	0,0	Tompkins Financial	4 158	2 502	0,0
ServisFirst Bancshares	10 523	4 651	0,0	TopBuild	5 937	17 059	0,1
Shake Shack A	9 200	7 723	0,1	Topgolf Callaway Brands	26 697	5 724	0,0
Shenandoah Telecommunications	9 923	2 083	0,0	Toro	18 439	20 245	0,2
Shift4 Payments A	7 900	5 795	0,0	TowneBank	13 088	3 285	0,0
Shoals Technologies Group A	22 500	6 212	0,0	TPG A	11 500	3 635	0,0
ShockWave Medica	6 400	19 730	0,2	TPR	45 346	20 963	0,2
Shutterstock	4 400	2 313	0,0	Tradeweb Markets A	16 500	12 205	0,1
Silgan Holdings	20 688	10 478	0,1	TransMedics Group	5 000	4 535	0,0
Silicon Laboratories	6 837	11 649	0,1	Travel Leisure	10 400	4 532	0,0
Silk Road Medical	7 000	2 457	0,0	Traverse Therapeutics	16 200	2 688	0,0
Simmons First National A	20 260	3 775	0,0	Treace Medical Concepts	5 500	1 520	0,0
Simply Good Foods	17 300	6 837	0,1	TreeHouse Foods	5 409	2 943	0,0
Simpson Manufacturing	7 837	11 724	0,1	Trex	18 332	12 981	0,1
Simulations Plus	3 400	1 591	0,0	TRI Pointe Homes	20 755	7 367	0,1
Sinclair	10 367	1 548	0,0	TriMas	12 595	3 740	0,0
Site Centers	23 880	3 410	0,0	TriNet Group	7 037	7 219	0,1
SiteOne Landscape	6 837	12 359	0,1	Trinity Industries	13 490	3 746	0,0
SITim	2 500	3 186	0,0	Trinseo	5 930	812	0,0
Six Flags Entertainment	14 995	4 208	0,0	TripAdvisor	19 900	3 544	0,0
SJW Group	6 765	5 123	0,0	Triumph Financial	5 600	3 673	0,0
Skechers USA A	24 090	13 702	0,1	Trupanion	5 900	1 254	0,0
Skyline Champion	10 500	7 423	0,1	Trustmark	14 760	3 367	0,0
Skywest	4 800	2 111	0,0	TTEC Holdings	2 600	950	0,0
SL Green Realty REIT	11 665	3 786	0,0	Two Harbors Investment REIT	13 249	1 986	0,0
Smartsheet A	20 400	8 430	0,1	Tyler Technologies	7 751	34 867	0,3
SoFi Technologies	113 400	10 215	0,1	U-Haul Holding	18 000	9 851	0,1
SolarWinds	7 700	853	0,0	U-Haul Holding	1 400	837	0,0
Sonic Automotive A	5 500	2 832	0,0	U.S. Steel	24 900	6 726	0,1
Sonoco Products	11 367	7 246	0,1	Ubiquiti	2 258	4 286	0,0
Sonos	29 000	5 115	0,0	Udemy	8 800	1 020	0,0
Sotera Health	24 100	4 904	0,0	UFP Industries	9 295	9 744	0,1
Southside Bancshares	7 809	2 207	0,0	UiPath A	75 300	13 477	0,1
SouthState	12 058	8 570	0,1	Ultra Clean Holdings	15 000	6 231	0,0
Sovos Brands	2 000	423	0,0	Ultragenyx Pharmaceutical	14 623	7 286	0,1
Spectrum Brands Holdings	9 543	8 045	0,1	UMB Financial	10 930	7 190	0,1
Sphere Entertainment Co	5 800	1 716	0,0	Under Armour	44 600	3 478	0,0
Spirit Airlines	15 700	2 910	0,0	Under Armour C	44 800	3 247	0,0
Spirit Realty Capital REIT	24 955	10 615	0,1	Unifirst	3 279	5 490	0,0
SpringWks Therapeutics	7 000	1 982	0,0	United Bankshares	22 146	7 097	0,1
Sprinklr A	6 100	911	0,0	United Community Banks	14 839	4 005	0,0
Sprout Social A	8 500	4 238	0,0	United Natural Foods	9 300	1 964	0,0
Sprouts Farmers Market	21 800	8 649	0,1	United Therapeutics	7 300	17 406	0,1
SPS Commerce	6 600	13 692	0,1	Univar Solutions	31 539	12 209	0,1
SPX Technologies	7 209	6 616	0,1	Universal Display	8 500	13 233	0,1
Squarespace A	3 100	1 056	0,0	Universal Health Services	8 200	13 974	0,1
St Joe	7 374	3 850	0,0	Unum Group	28 307	14 584	0,1
Staar Surgica	8 900	5 054	0,0	Upbound Group	9 452	3 178	0,0
STAG Industrial REIT	37 502	14 534	0,1	Upstart Holdings	10 000	3 868	0,0
Standard Motor Products	4 100	1 662	0,0	Upwork	20 600	2 078	0,0
Standex Internationa	2 700	4 126	0,0	Uranium Energy	107 200	3 937	0,0

Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
Urban Edge Properties	31 390	5 232	0,0
Urban Outfitters	13 453	4 814	0,0
US Foods Holding	29 941	14 230	0,1
US Physical Therapy	400	524	0,0
Usana Health Sciences	2 800	1 907	0,0
Utz Brands A	9 800	1 732	0,0
Valley National	92 087	7 709	0,1
Valmont Industries	3 865	12 150	0,1
Valvoline	27 600	11 182	0,1
Varonis Systems	17 600	5 066	0,0
Vaxcyte	12 700	6 851	0,1
Ventyx Biosciences	6 400	2 267	0,0
VeracYTE	14 375	3 955	0,0
Veradigm	26 871	3 657	0,0
Vericel	8 700	3 531	0,0
Verint Systems	8 888	3 366	0,0
Veris Residential	20 039	3 474	0,0
Veritiv Corp	1 000	1 357	0,0
Verra Mobility A	33 800	7 199	0,1
Vertex A	6 700	1 411	0,0
Vertiv Holdings A	59 700	15 973	0,1
Verve Therapeutics	5 500	1 114	0,0
VF	52 100	10 743	0,1
Viavi Solutions	30 910	3 783	0,0
Victoria's Secret & Co	8 300	1 563	0,0
Viking Therapeutics	15 400	2 696	0,0
Vir Biotechnology	13 200	3 497	0,0
Virgin Galactic Holdings A	31 600	1 324	0,0
Virtu Financial A	17 100	3 157	0,0
Virtus Investment Partners	1 200	2 560	0,0
Vishay Intertechnology	28 297	8 986	0,1
Visteon	4 651	7 215	0,1
Vontier	22 600	7 863	0,1
Vornado Realty Trust	31 600	6 192	0,0
Voya Financial	32 400	25 096	0,2
Walker & Dunlop	5 651	4 828	0,0
Warby Parker A	10 300	1 301	0,0
Washington Federal	18 874	5 406	0,0
Watsco	6 458	26 609	0,2
Watts Water Technologies A	6 144	12 193	0,1
Wayfair	16 200	11 376	0,1
WD-40	2 565	5 227	0,0
Webster Financial	29 093	11 863	0,1
Weis Markets	1 600	1 110	0,0
Wendys	30 757	7 226	0,1
Werner Enterprises	8 330	3 975	0,0
Wesco International	9 293	17 973	0,1
Westamerica Bancorporation	5 530	2 288	0,0
Western Alliance	15 860	6 248	0,0
Western Union	52 600	6 664	0,1
Westlake	7 200	9 291	0,1
WestRock	32 200	10 111	0,1
WEX	6 244	12 279	0,1
WideOpenWest	14 200	1 295	0,0
Williams Sonoma	10 660	14 409	0,1
WillScot Mobile Mini Holdings A	38 573	19 911	0,2
Wingstop	4 444	9 608	0,1
Winnebago Industries	6 644	4 786	0,0
Wintrust Financial	8 823	6 921	0,1
Wolfspeed	8 100	4 864	0,0
Wolverine World Wide	15 532	2 464	0,0
Workiva A	6 900	7 577	0,1
World Wrestling Entertainment A	8 037	9 416	0,1
Worthington Industries	3 616	2 713	0,0
WSFS Financial	9 205	3 750	0,0
Wyndham Hotels Resorts	15 700	11 628	0,1
Xencor	13 500	3 641	0,0
Xerox Holdings	19 000	3 059	0,0
Xpel	5 222	4 750	0,0
XPO	17 100	10 897	0,1
Yelp A	14 481	5 695	0,0
Yeti Holdings	21 300	8 936	0,1
Zentaris Pharma	8 300	2 529	0,0
Zeta Global Holdings A	31 200	2 878	0,0
Ziff Davis	7 216	5 461	0,0
Zillow Group A	7 700	4 092	0,0
Zillow Group C	30 200	16 395	0,1
Zions Bancorporation	25 100	7 282	0,1
ZoomInf Technologies	44 000	12 067	0,1
Zuora A	21 200	2 512	0,0
Zurn Elkay Water Solutions	24 218	7 034	0,1
		<b>8 254 305</b>	<b>63,9</b>
<b>ÖSTERRIKE</b>			
Austria Technologie & System	5 350	2 075	0,0
DO & CO Aktiengesellschaft	1 882	2 777	0,0
Kontron	10 651	2 273	0,0
Lenzing	2 390	1 263	0,0
PIERER Mobility	275	254	0,0
RHI Magnesita O	3 910	1 424	0,0
S Immo	15 210	2 187	0,0
		<b>12 253</b>	<b>0,1</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>12 805 208</b>	<b>99,1</b>

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES** **0,0**

	Underliggande exponering tSEK	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
--	-------------------------------	--------------------	----------------

**AKTIEINDEXTERMINER**

E-Mini Russ 2000 Sep 2023	98 700	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>

**Överlåtbara värdepapper som är föremål för regelbunden handel****vid någon annan marknad som är reglerad och öppen för allmänheten** **0,1**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
--	--------------------------	--------------------	----------------

**NOTERADE AKTIER****SVERIGE**

Paradox Interactive	9 955	2 710	0,0
Powercell Sweden	12 493	1 049	0,0
Surgical Science Sweden	4 076	983	0,0
Vimian Group	24 627	630	0,0
		<b>5 372</b>	<b>0,0</b>

**TYSKLAND**

Zooplus SE	1 191	4 056	0,0
		<b>4 056</b>	<b>0,0</b>

**Noterade aktier****9 428** **0,1****Övriga finansiella instrument** **0,1**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
--	--------------------------	--------------------	----------------

**ONOTERADE AKTIER****ITALIEN**

Bio-On	1 950	0	0,0
		<b>0</b>	<b>0,0</b>

**KANADA**

BELLUS Health	16 200	2 579	0,0
Resolute Forest Products	3 800	0	0,0
		<b>2 579</b>	<b>0,0</b>

**STORBRIANNIEN**

Kape Technologies	32 935	1 289	0,0
		<b>1 289</b>	<b>0,0</b>

**SVERIGE**

Befimmo	7 140	3 879	0,0
		<b>3 879</b>	<b>0,0</b>

**USA**

BGC Partners A	76 178	3 645	0,0
GLIBA-LBRDK Temp	16 581	0	0,0
New York REIT	13 388	0	0,0
OmniAb - 12.5 Earnout	817	0	0,0
OmniAb - 15.00 Earnout	817	0	0,0
		<b>3 645</b>	<b>0,0</b>

**ÖSTERRIKE**

Lenzing R	2 390	93	0,0
		<b>93</b>	<b>0,0</b>

**Onoterade aktier****11 485** **0,1**

	Underliggande exponering tSEK	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
--	-------------------------------	--------------------	----------------

**OPTIONER OCH WARRANTER**

Webuild Warrant 210802	142	0	0,0
<b>Optioner och warrant</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>

**Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde** **12 826 121** **99,3****Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde** **0** **0,0**Netto, övriga tillgångar och skulder **96 462** **0,7****Total summa fondförmögenhet** **12 922 583** **100,0**

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Sammanställning, företags- och koncernexponeringar\***

Företag/koncern	% av fondförmögenheten	Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Liberty Media Corp	0,4	Zillow Group	0,2

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehåller mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

Handelsbanken Global Småbolag Index Criteria, forts.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

<b>Volym utlånade värdepapper, tSEK</b>	<b>2 083 394</b>
---	------------------

<b>Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar</b>	<b>16,2</b>
--	-------------

**De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:**

Amerikanska staten	472 835
Brittiska staten	165 906
Franska staten	119 203
Nvidia	38 518
Starbucks	29 233
Genuine Parts	29 012
Deere & Co	28 192
Keysight Technologies	26 859
Abbvie	26 412
Masco	26 337

**De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:**

Barclays Bank	855 847
UBS AG London Branch	462 127
Barclays Capital Securities	161 808
BNP Paribas Arbitrage SNC	161 263
Merrill Lynch International	129 256
SEB	109 377
J.P. Morgan Securities	109 191
HSBC Bank	95 529
Goldman Sachs International	79 962
Citigroup Global Markets	79 202

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:**

Obligationer och andra räntebärande instrument	813 905
Aktier	1 493 320
	<b>2 307 225</b>

Vi godtar statsobligationer och statskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	2 172
En till tre månader	3 321
Tre månader till ett år	46 332
Mer än ett år	762 080
Obestämmd löptid	1 493 320
	<b>2 307 225</b>

**Motparternas hemvist, tSEK**

Frankrike	161 263
Storbritannien	2 016 563
Sverige	129 400
	<b>2 307 225</b>

**Säkerheternas valuta, tSEK**

AUD	7 395
CHF	11 264
DKK	3 709
EUR	190 423
GBP	246 906
HKD	21 163
JPY	284 441
NZD	244
SEK	4 149
SGD	2 004
USD	1 535 529
	<b>2 307 225</b>

**Avveckling och clearing, tSEK**

Tredje part	2 307 225
-------------	-----------

	<b>2 307 225</b>
--	------------------

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämmd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 9 903 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- Barclays Bank
- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- Credit Suisse International
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- Morgan Stanley Europe SE
- SEB
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende sponsrad, garanterad, godkänd, emitterad, marknadsförd, såld eller understödd på något annat sätt av Solactive AG (Solactive) och Solactive lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av dess index, index varumärke eller indexnivå kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. Indexet beräknas och publiceras av Solactive. Solactive gör sitt bästa för att se till att indexet beräknas korrekt. Oavsett skyldigheter gentemot fondens emittent har Solactive ingen skyldighet att påpeka fel i indexet till tredje part, inklusive men inte begränsat till investerare i fonden och/eller finansiella intermediärer i fonden. Varken offentliggörande av index eller licensiering av index eller index varumärke för användning i samband med fonden utgör någon rekommendation från Solactive att investera kapital i fonden, ej heller utgör det inte på något sätt en försäkran eller åsikt från Solactive avseende eventuella investeringar i denna fond.



# Handelsbanken Norden Index Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index NTR så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltat. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet kommer att efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,2%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagsändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet är återinvesterande, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet, justerat för skatt. Fonden följer ett registrerat EU-referensvärde (index) för anpassning till Parisavtalets mål om minskade koldioxidutsläpp. Indexet speglar bolag noterade på Stockholmsbörsen, Oslo Börs, Köpenhamnsbörsen samt Helsingforsbörsen exklusive de bolag som inte uppfyller hållbarhetskraven. Hållbarhetskraven i indexet syftar till en minskning av koldioxidutsläppen och bolagen i index väljs ut och viktas på så sätt att indexportföljens utsläpp av växthusgaser anpassas till de långsiktiga globala uppvärmningsmålen i Parisavtalet. Hållbarhetskraven i index innebär vidare att bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer, bolag som avsevärt skadar miljömässiga mål samt bolag som är verksamma inom kontroversiella sektorer inte ingår i index. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 9,5% under första halvåret 2023\*. Fonden följer ett index, Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index, som är i linje med Parisavtalets klimatmål, så kallat EU Paris Aligned Benchmarks. Denna utveckling är ett viktigt steg på vägen mot att nå fondbolagets mål om netto-noll-utsläpp i portföljerna till år 2040 samt att linjera allt förvaltad kapital i enlighet med Parisavtalets målsättningar. Indexet består av ca 450 aktier. De tre största innehaven i fonden är Novo Nordisk, Atlas Copco och Investor. De tre största sektorerna utgjorde ca 70% av fonden och bestod av Hälsovård, Industri och Finans.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Norden. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker dock i företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Då fondens investeringar sker i utländska aktier denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. Då fonden består av olika andelsklasser kan förändringar i valutakurser medföra att värdet och riskklassificeringen skiljer sig åt mellan olika andelsklasser beroende på vilken valuta andelsklassen handlas i. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en

faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0,7%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0,2%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0,4%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är upp för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är upp för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans



Handelsbanken Norden Index Criteria, forts.

Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %									
SEK	10,8	10,2	-	-	-	-	-	-	-
EUR	8,2	7,5	-	-	-	-	-	-	-
NOK	12,7	9,0	-	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK	5,18	5,28	5,29	-	-	-	-	-	-
Omräkningskurs EUR/SEK	11,78	11,12	10,30	10,05	10,51	10,13	9,83	-	-
Omräkningskurs NOK/SEK	1,01	1,06	1,03	0,96	1,07	1,02	1,00	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta – historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.  
1) En justering har gjorts under 2023, vilket förklarar varför avkastningen mellan andelsklasserna skiljer sig åt. Justeringen påverkar inte det faktiska värdet i andelsklasserna.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index

T o m 2020-06-16: SIX SRI Nordic Index NI

T o m 2021-08-31: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se Information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Norden Index Criteria A1	0,40
Norden Index Criteria A9	0,20
Norden Index Criteria B1	0,40
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Norden Index Criteria A1	0,40
Norden Index Criteria A9	0,20
Norden Index Criteria B1	0,40
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Norden Index Criteria A1	0,43
Norden Index Criteria A9	0,23
Norden Index Criteria B1	0,43
Transaktionskostnader, tSEK	4 026
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,02

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,2
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	17,8
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk % - A1 SEK	17,7	Aktiv avkastning % - B1 SEK	-0,5
Total risk % - A1 EUR	20,8	Informationskvot - A1 SEK	0,0
Total risk % - A1 NOK	17,9	Informationskvot - A1 EUR	0,0
Total risk % - A9 SEK	17,7	Informationskvot - A1 NOK	0,0
Total risk % - A9 EUR	20,8	Informationskvot - A9 SEK	Negativ
Total risk % - A9 NOK	17,9	Informationskvot - A9 EUR	1,0
Total risk % - B1 SEK	17,7	Informationskvot - A9 NOK	1,1
Total risk i index % - A1 SEK	17,8	Informationskvot - B1 SEK	Negativ
Total risk i index % - A1 EUR	20,9	Sharpekvot - A1 SEK	0,1
Total risk i index % - A1 NOK	17,9	Sharpekvot - A1 EUR	-0,3
Total risk i index % - A9 SEK	17,8	Sharpekvot - A1 NOK	0,0
Total risk i index % - A9 EUR	20,9	Sharpekvot - A9 SEK	0,1
Total risk i index % - A9 NOK	17,9	Sharpekvot - A9 EUR	-0,2
Total risk i index % - B1 SEK	17,8	Sharpekvot - A9 NOK	0,1
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG	Sharpekvot - B1 SEK	0,1
	Screened Paris Aligned	Sharpekvot i index - A1 SEK	0,1
	Nordic Index	Sharpekvot i index - A1 EUR	-0,3
Aktiv avkastning % - A1 SEK	0,0	Sharpekvot i index - A1 NOK	0,0
Aktiv avkastning % - A1 EUR	0,0	Sharpekvot i index - A9 SEK	0,1
Aktiv avkastning % - A1 NOK	0,0	Sharpekvot i index - A9 EUR	-0,3
Aktiv avkastning % - A9 SEK	-0,2	Sharpekvot i index - A9 NOK	0,0
Aktiv avkastning % - A9 EUR	0,2	Sharpekvot i index - B1 SEK	0,1
Aktiv avkastning % - A9 NOK	0,2		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	37 351 711	98,8	32 221 061	99,6
OTC-derivatinstrument med positivt marknadsvärde	16	0,0	-	-
Fondandelar	281 515	0,7	39 813	0,1
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde<sup>Not 1)</sup></b>	<b>37 633 242</b>	<b>99,5</b>	<b>32 260 874</b>	<b>99,7</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	152 905	0,4	-98 847	-0,3
Förtbetalda kostnader och upplupna intäkter	103 240	0,3	72 956	0,2
Övriga tillgångar	10 465	0,0	208 339	0,6
<b>Summa tillgångar</b>	<b>37 899 852</b>	<b>100,3</b>	<b>32 443 322</b>	<b>100,3</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förtbetalda intäkter	12 896	0,0	11 783	0,0
Övriga skulder	83 224	0,2	77 315	0,2
<b>Summa skulder</b>	<b>96 120</b>	<b>0,3</b>	<b>89 097</b>	<b>0,3</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>37 803 733</b>	<b>100,0</b>	<b>32 354 225</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	2 767 144	7,3	2 680 527	8,3
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	3 102 410	8,2	2 934 316	9,1
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	15 684	0,0	6 478	0,0

1) Likvida medel 15 684 tSEK

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 98,8**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>BERMUDA</b>			
AutoStore Holdings	1 224 739	28 955	0,1
		<b>28 955</b>	<b>0,1</b>
<b>DANMARK</b>			
A.P. Møller-Mærsk B	12 466	236 257	0,6
ALK-Abello B	528 246	62 242	0,2
Alm Brand	2 053 192	34 704	0,1
Ambu B	578 093	102 150	0,3
Bang & Olufsen	137 257	2 294	0,0
Bavarian Nordic	282 454	86 723	0,2
cBrain	63 016	15 478	0,0
Chemometec	93 274	68 791	0,2
Chr. Hansen Holding	265 985	199 366	0,5
Coloplast B	323 632	437 004	1,2
Danske Bank	1 546 809	406 376	1,1
Dong Energy	465 112	474 641	1,3
DSV	416 532	944 664	2,5
FLSmidth	82 287	43 002	0,1
Genmab	154 828	632 197	1,7
GN Store Nord	377 278	101 626	0,3
Green Hydrogen Systems	520 641	7 943	0,0
H. Lundbeck A	689 299	33 077	0,1
H. Lundbeck B	1 300 536	66 771	0,2
H&H International	44 844	5 798	0,0
Hinode	27 030	21 603	0,1
ISS	356 645	81 421	0,2
Jeudan	81 117	32 993	0,1
Jyske Bank	107 435	88 144	0,2
Matas	106 702	16 988	0,0
Netcompany Group	122 032	54 541	0,1
Nilfisk Holding	11 490	2 284	0,0
NKT	135 164	88 519	0,2
Nnit	57 007	7 191	0,0
Novo Nordisk	3 639 079	6 331 843	16,7
Novozymes	498 787	250 951	0,7
NTG Nordic Transport Group	45 822	31 292	0,1
Pandora Holding	230 053	221 805	0,6
Per Aarsleff	14 898	7 910	0,0
Ringkjøbing Landbobank	62 204	96 232	0,3
Rockwool A	1 175	3 265	0,0







Handelsbanken Norden Index Criteria, forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>OTC-DERIVATINSTRUMENT</b>			
<b>VALUTATERMINER</b>			
DKK/SEK <sup>1)</sup>		3	0,0
EUR/SEK <sup>2)</sup>		13	0,0
		<b>16</b>	<b>0,0</b>
<b>OTC-derivatinstrument</b>		<b>16</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>37 633 242</b>	<b>99,5</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		170 490	0,5
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>37 803 733</b>	<b>100,0</b>

1) tDKK 2 700/tSEK -4 270, motpart Svenska Handelsbanken

2) tEUR 1 350/tSEK -15 895, motpart Svenska Handelsbanken

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Sammanställning, företags- och koncernexponeringar\***

Företag/koncern	% av fondförmögenheten	Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Atlas Copco	3,7	Kesko	0,4
Investor	2,9	Sagax	0,4
Volvo	1,3	Rockwool	0,3
Epiroc	1,3	H Lundbeck	0,3
SEB	1,1	Kinnevik	0,3
SCA	0,6	NKT	0,2
Industrivärden	0,5	Schibsted	0,2
Orion	0,5	Corem Property Group	0,1

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehar mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**Volym utlånade värdepapper, tSEK **2 767 144**Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar **7,4****De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:**

Amerikanska staten	1 290 301
Franska staten	343 796
Brittiska staten	127 610
Hsbc Holdings	52 767
Tyska staten	44 642
Rio Tinto	35 345
AstraZeneca	34 112
Österrikiska staten	32 017
BP	31 200
Unilever	27 399

**De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:**

SEB	773 697
J.P. Morgan Securities	391 916
BNP Paribas Arbitrage SNC	387 642
Svenska Handelsbanken	371 523
Morgan Stanley & Co. International	354 895
Citigroup Global Markets	247 206
Goldman Sachs International	182 169
UBS AG London Branch	179 063
Merrill Lynch International	144 128
HSBC Bank	70 172

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:**

Obligationer och andra räntebärande instrument	1 889 308
Aktier	1 213 102
	<b>3 102 410</b>

**Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	3 192
En till tre månader	12 793
Tre månader till ett år	69 655
Mer än ett år	1 803 668
Obestämmd löptid	1 213 102
	<b>3 102 410</b>

**Motparternas hemvist, tSEK**

Frankrike	387 642
Storbritannien	1 569 549
Sverige	1 145 219
	<b>3 102 410</b>

**Säkerheternas valuta, tSEK**

AUD	2 144
CHF	27 768
DKK	13 804
EUR	539 543
GBP	547 790
HKD	43 133
JPY	110 941
NZD	577
SEK	30 349
SGD	4 120
USD	1 782 240
	<b>3 102 410</b>

**Avveckling och clearing, tSEK**

Tredje part	3 102 410
	<b>3 102 410</b>

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- SEB
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende sponsrad, garanterad, godkänd, emitterad, marknadsförd, såld eller understödd på något annat sätt av Solactive AG (Solactive) och Solactive lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av dess index, index varumärke eller indexnivå kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. Indexet beräknas och publiceras av Solactive. Solactive gör sitt bästa för att se till att indexet beräknas korrekt. Oavsett skyldigheter gentemot fondens emittent har Solactive ingen skyldighet att påpeka fel i indexet till tredje part, inklusive men inte begränsat till investerare i fonden och/eller finansiella intermediärer i fonden. Varken offentliggörande av index eller licensering av index eller index varumärke för användning i samband med fonden utgör någon rekommendation från Solactive att investera kapital i fonden, ej heller utgör det inte på något sätt en försäkring eller åsikt från Solactive avseende eventuella investeringar i denna fond.



# Handelsbanken Norge Index Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Norway Index TR så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet kommer att efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,4%. Förvaltningsavgift, kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet är återinvesterande, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet, justerat för skatt. Fonden följer ett registrerat EU-referensvärde (index) för anpassning till Parisavtalets mål om minskade koldioxidutsläpp. Indexet speglar bolag noterade på Oslo Börs exklusive de bolag som inte uppfyller hållbarhetskraven. Hållbarhetskraven i indexet syftar till en minskning av koldioxidutsläppen och bolagen i index väljs ut och viktas på så sätt att indexportföljens utsläpp av växthusgaser anpassas till de långsiktiga globala uppvärmningsmålen i Parisavtalet. Hållbarhetskraven i index innebär vidare att bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer, bolag som avsevärt skadar miljömässiga mål samt bolag som är verksamma inom kontroversiella sektorer inte ingår i index. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 0,4% under första halvåret 2023\*. Fonden följer ett index, Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Norway Index, som är i linje med Parisavtalets klimatmål, så kallat EU Paris Aligned Benchmarks. Denna utveckling är ett viktigt steg på vägen mot att nå fondbolagets mål om netto noll-utsläpp i våra portföljer till år 2040 samt att linjera allt förvaltad kapital i enlighet med Parisavtalets målsättningar. Indexet består av ca 88 aktier. De tre största aktieinnehaven vid årsskiftet var DNB, MOWI och Orkla. De tre största sektorerna utgjorde ca 61% av portföljen och bestod av dagligvarubolag, finans samt industrivaror- och tjänster.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Norge. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker dock i företag i flera sektorer eller branscher vilket över tid bidrar till att minska risken i fonden. Då fonden består av olika andelsklasser kan förändringar i valutakurser medföra att riskklassificeringen skiljer sig åt mellan olika andelsklasser beroende på vilken valuta andelsklassen handlas i. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av

dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fonderportföljen.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

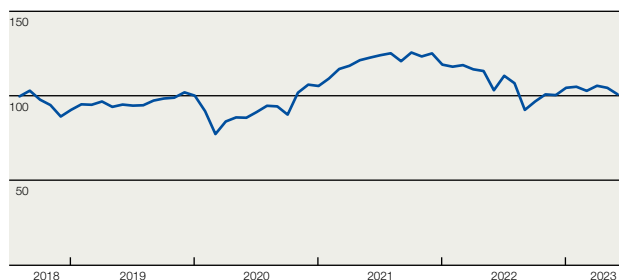
Handelsbanken Norge Index Criteria, forts.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas

informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

### Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

### Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, NOK										
Norge Index Criteria A1 - NOK	101,13	100,68	125,38	106,89	102,32	88,02	-	-	-	-
Norge Index Criteria A9 - NOK	102,11	101,57	126,22	107,39	102,60	88,09	-	-	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnNOK	70	137	-1 218	689	310	856	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnNOK	1 197	1 124	1 254	2 138	1 241	773	-	-	-	-
Norge Index Criteria A1 - NOK	551	503	596	666	487	197	-	-	-	-
Norge Index Criteria A9 - NOK	647	621	658	1 472	754	577	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	11 779	11 111	9 965	19 934	12 110	8 781	-	-	-	-
Norge Index Criteria A1 - NOK	5 445	4 992	4 752	6 231	4 761	2 233	-	-	-	-
Norge Index Criteria A9 - NOK	6 334	6 119	5 212	13 704	7 349	6 548	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Norge Index Criteria A1 - NOK	0,4	-19,7	17,3	4,5	16,2	-12,0	-	-	-	-
Norge Index Criteria A9 - NOK	0,5	-19,5	17,5	4,7	16,5	-11,9	-	-	-	-
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Norge Index Criteria A1 - NOK	0,3	-20,0	16,9	4,6	16,5	-11,9	-	-	-	-
Norge Index Criteria A9 - NOK	0,3	-20,0	16,9	4,6	16,5	-11,9	-	-	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Norge Index Criteria A1 - NOK	0,3	0,3	0,2	0,1	-	-	-	-	-	-
Norge Index Criteria A9 - NOK	0,3	0,3	0,2	0,1	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Norge Index Criteria A1 - NOK	-9,3	-2,9	10,7	10,2	-	-	-	-	-	-
Norge Index Criteria A9 - NOK	-9,1	-2,8	10,9	10,4	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	-9,7	-3,3	10,6	10,4	-	-	-	-	-	-
Omräkningskurs NOK/SEK	1,01	1,06	1,03	0,96	1,07	1,02	-	-	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta – historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Norway Index

T o m 2021-08-31: OSEBX

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se Information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

### Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Norge Index Criteria A1	0,30
Norge Index Criteria A9	0,10
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Norge Index Criteria A1	0,30
Norge Index Criteria A9	0,10
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Norge Index Criteria A1	0,37
Norge Index Criteria A9	0,17
Transaktionskostnader, tNOK	206
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,02

### Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,4
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	3,2
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

### Risk- och avkastningsmått\*

Total risk % - A1 NOK	17,6	Aktiv avkastning % - A9 NOK	0,6
Total risk % - A9 NOK	17,6	Informationskvot - A1 NOK	1,7
Total risk i index % - A1 NOK	17,7	Informationskvot - A9 NOK	2,3
Total risk i index % - A9 NOK	17,7	Sharpekvot - A1 NOK	-0,6
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Norway Index	Sharpekvot - A9 NOK	-0,6
Aktiv avkastning % - A1 NOK	0,5	Sharpekvot i index - A1 NOK	-0,6
		Sharpekvot i index - A9 NOK	-0,6

\* Riskiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

Handelsbanken Norge Index Criteria, forts.

## Balansräkning, tNOK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	1 194 917	99,8	1 122 908	99,9
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde<sup>Not 1)</sup></b>	<b>1 194 917</b>	<b>99,8</b>	<b>1 122 908</b>	<b>99,9</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	1 855	0,2	575	0,1
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	2 337	0,2	850	0,1
<b>Summa tillgångar</b>	<b>1 199 109</b>	<b>100,1</b>	<b>1 124 333</b>	<b>100,0</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	260	0,0	234	0,0
Övriga skulder	1 406	0,1	-	-
<b>Summa skulder</b>	<b>1 665</b>	<b>0,1</b>	<b>234</b>	<b>0,0</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>1 197 443</b>	<b>100,0</b>	<b>1 124 099</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	192 010	16,0	88 157	7,8
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	213 840	17,9	97 889	8,7

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 99,8**

	Antal/Nom. bel. tusen	Marknadsvärde tNOK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>BERMUDA</b>			
AutoStore Holdings	5 922	139	0,0
		<b>139</b>	<b>0,0</b>
<b>DANMARK</b>			
Cadeler	113 975	5 117	0,4
		<b>5 117</b>	<b>0,4</b>
<b>FÄRÖARNA</b>			
Bakkafrost	40 956	26 294	2,2
		<b>26 294</b>	<b>2,2</b>
<b>NORGE</b>			
ABG Sundal Collier Holding	290 250	1 512	0,1
Adevinta	241 486	17 001	1,4
AF Gruppen	98 297	13 074	1,1
Aker Carbon Capture	2 281 165	32 028	2,7
Aker Horizons	240 344	1 632	0,1
Atea	4 042	631	0,1
Atlantic Sapphire	1 519 030	9 950	0,8
Austevoll Seafood	133 801	9 921	0,8
Axactor	67 671	344	0,0
B2Holding	248 680	1 651	0,1
Belships	14 809	250	0,0
BEWi	79 090	3 187	0,3
Biotec Pharmacon	306 263	12 251	1,0
Bonheur	72 889	18 951	1,6
Borregaard	118 602	18 834	1,6
Bouvet	68 149	4 423	0,4
Cloudberry Clean Energy	1 951 179	24 936	2,1
Crayon Group Holding	48 529	5 096	0,4
DNB Bank	668 832	134 235	11,2
Elkem	21 674	538	0,0
Elliptic Laboratories	265 887	3 903	0,3
Elmera Group	10 167	217	0,0
Elopak	284 470	6 642	0,6
Endur ASA	30 319	1 182	0,1
Entra	262 043	25 497	2,1
Europris	361 944	25 915	2,2
Froy	70 258	5 297	0,4
Gjensidige Forsikring	176 717	30 360	2,5
Grieg Seafood	132 494	8 890	0,7
Hexagon Composites	260 066	7 079	0,6
Hexagon Purus	473 072	9 627	0,8
Hoegh Autoliners	1 744	106	0,0
HydrogenPro	177 494	3 461	0,3
I dex	5 143 916	3 673	0,3
Kahoot	252 453	7 392	0,6
Kid	125 506	9 463	0,8
Kongsberg Automotiv Holding	912 309	2 239	0,2
Lerøy Seafood Group	374 205	15 238	1,3
Link Mobility Group Holding	231 269	2 613	0,2
Mowi	332 112	56 525	4,7
MPC Container Ships	442 062	8 094	0,7
Multiconsult	1 094	168	0,0
Nel	2 679 587	33 736	2,8
Nordic Semiconductor	306 119	39 933	3,3
Norsk Hydro	979 426	62 487	5,2
Norske Skog	228 198	9 635	0,8
Norwegian Air Shuttle	145 889	1 503	0,1
Nykode Therapeutics	848 998	22 244	1,9
Orkla	892 092	68 780	5,7
Pareto Bank	40 771	2 037	0,2
Pexip Holding	171 055	3 336	0,3
Photocure	185 896	8 681	0,7
poLight	247 214	2 823	0,2

	Antal/Nom. bel. tusen	Marknadsvärde tNOK	% av fondförm.
Protector Forsikring	34 575	5 712	0,5
Rana Gruber	6 852	383	0,0
REC	153 981	2 473	0,2
SalMar	86 703	37 534	3,1
Salmon Evolution	1 527 631	9 716	0,8
SATS	41 241	412	0,0
Scatec	418 496	29 420	2,5
Schibsted A	80 176	15 093	1,3
Schibsted B	84 100	14 953	1,2
Selvaag Bolig	227 789	7 358	0,6
SpareBank 1 Midt-Norge	105 818	14 920	1,2
SpareBank 1 Nord-Norge	81 506	7 914	0,7
SpareBank 1 Ostlandet	37 305	4 850	0,4
SpareBank 1 SR-Bank	144 217	18 763	1,6
Sparebanken Vest	81 868	8 432	0,7
Storebrand	330 144	27 620	2,3
Telenor	493 002	53 639	4,5
Tomra Systems	327 517	56 497	4,7
Ultimovacs	33 440	2 582	0,2
Veidekke	144 222	16 586	1,4
Vow	288 622	3 758	0,3
Wilh. Wilhelmsen	509	38	0,0
XXL	1 236 208	2 200	0,2
Yara International	61 461	23 294	1,9
		<b>1 163 367</b>	<b>97,2</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>1 194 917</b>	<b>99,8</b>

<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>	<b>1 194 917</b>	<b>99,8</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>	<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder	2 526	0,2
<b>Total summa fondförmögenhet</b>	<b>1 197 443</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

## Sammanställning, företags- och koncernexponeringar\*

Företag/koncern % av fondförmögenheten

Schibsted 2,5

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehar mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

Handelsbanken Norge Index Criteria, forts.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

<b>Volym utlånade värdepapper, tNOK</b>	<b>192 010</b>
---	----------------

<b>Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar</b>	<b>16,1</b>
--	-------------

**De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tNOK:**

Amerikanska staten	44 151
Franska staten	36 608
Brittiska staten	18 256
Tyska staten	3 523
Österrikiska staten	2 953
Hsbc Holdings	2 864
Rio Tinto	2 200
AstraZeneca	2 020
Nederländska staten	1 963
Shell	1 925

**De största motparterna för värdepapperslån, tNOK:**

SEB	41 814
Merrill Lynch International	40 574
BNP Paribas Arbitrage SNC	32 319
Barclays Capital Securities	28 596
J.P. Morgan Securities	23 202
UBS AG London Branch	18 595
Svenska Handelsbanken	18 376
Citigroup Global Markets	10 364

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tNOK:**

Aktier	104 320
Obligationer och andra räntebärande instrument	109 520

**213 840**

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, tNOK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	477
En till tre månader	615
Tre månader till ett år	9 385
Mer än ett år	99 044
Obestämmd löptid	104 320

**213 840****Motparternas hemvist, tNOK**

Frankrike	32 319
Storbritannien	121 331
Sverige	60 190

**213 840****Säkerheternas valuta, tNOK**

AUD	176
CHF	561
DKK	2 015
EUR	53 907
GBP	47 305
HKD	2 575
JPY	32 278
NZD	76
SEK	2 631
SGD	55
USD	72 261

**213 840****Avveckling och clearing, tNOK**

Tredje part	213 840
-------------	---------

**213 840**

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämmd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 1 591 tNOK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- SEB
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende sponsrad, garanterad, godkänd, emitterad, marknadsförd, såld eller understödd på något annat sätt av Solactive AG (Solactive) och Solactive lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av dess index, index varumärke eller indexnivå kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. Indexet beräknas och publiceras av Solactive. Solactive gör sitt bästa för att se till att indexet beräknas korrekt. Övsett skyldigheter gentemot fondens emittent har Solactive ingen skyldighet att påpeka fel i indexet till tredje part, inklusive men inte begränsat till investerare i fonden och/eller finansiella intermediärer i fonden. Varken offentliggörande av index eller licensiering av index eller index varumärke för användning i samband med fonden utgör någon rekommendation från Solactive att investera kapital i fonden, ej heller utgör det inte på något sätt en försäkring eller åsikt från Solactive avseende eventuella investeringar i denna fond.



# Handelsbanken Sverige 100 Index Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Solactive ISS ESG Sweden 100 Tradable så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltat. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,2%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet är återinvesterande, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet, justerat för skatt. Det index som fonden följer innefattar hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven innebär att index väljer bort bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer samt bolag med produktion eller distribution av fossila bränslen, krigsmateriel, tobak, cannabis, alkohol, kommersiell spelverksamhet och pornografi. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 11,4% under första halvåret 2023\*. Förutom att fonden har särskilda hållbarhetskriterier så placerar den utifrån de 100 största och mest omsatta bolagen på Stockholmsbörsen. Portföljen består av samtliga aktier som ingår i indexet. Index omviktas två gånger per år, sista maj och sista november. I omvikning i maj tillkom Embracer, Hemnet, Lindab, MIPS, Munters, NCAB Group och New Wave Group medan Bilica, Cint, Diös Fastigheter, Intrum, JM, NCC och Neobo fastigheter utgick. Vid halvårsskiftet var de tre största innehaven Atlas Copco, Investor och Volvo.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Sverige. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker dock i företag i flera sektorer eller branscher vilket över tid bidrar till att minska risken i fonden. Då fonden består av olika andelsklasser kan förändringar i valutakurser medföra att värdet och riskklassificeringen skiljer sig åt mellan olika andelsklasser beroende på vilken valuta andelsklassen handlas i. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har

fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 1,6%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0,5%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0,9%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fonddrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmontra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som

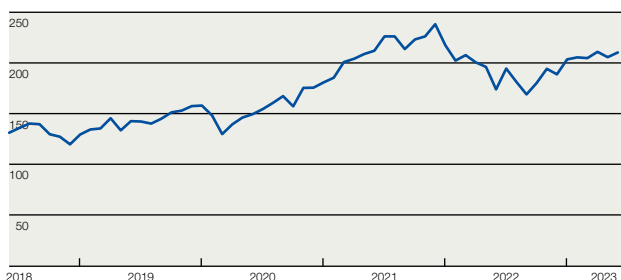


Handelsbanken Sverige 100 Index Criteria, forts.

kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Sverige 100 Index Criteria A1 - SEK	369,31	331,53	418,12	308,50	276,63	210,61	221,13	201,57	185,01	175,04
Sverige 100 Index Criteria A9 - SEK	371,27	333,12	419,71	309,36	277,12	210,78	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria A9 - NOK	102,61	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria B1 - SEK	132,61	123,92	163,49	125,62	-	-	-	-	-	-
Fondens totala nettolöfde, mnSEK	2 010	2 515	1 889	-74	398	834	-130	632	715	728
Fondförmögenhet totalt, mnSEK										
Sverige 100 Index Criteria A1 - SEK	18 535	14 782	16 269	10 411	9 459	6 935	6 557	6 080	4 997	3 513
Sverige 100 Index Criteria A9 - SEK	9 905	7 856	8 489	5 813	6 587	3 411	6 557	6 080	4 997	3 513
Sverige 100 Index Criteria A9 - SEK	8 205	6 760	7 527	4 540	2 872	3 524	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria A9 - NOK	144	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria B1 - SEK	279	166	253	58	-	-	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental										
Sverige 100 Index Criteria A1 - SEK	52 433	45 329	39 783	33 981	34 176	32 913	29 652	30 161	27 007	20 071
Sverige 100 Index Criteria A9 - SEK	26 821	23 697	20 303	18 842	23 813	16 193	29 652	30 161	27 007	20 071
Sverige 100 Index Criteria A9 - SEK	22 101	20 292	17 934	14 675	10 363	16 720	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria A9 - NOK	1 408	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria B1 - SEK	2 103	1 340	1 545	464	-	-	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Sverige 100 Index Criteria A1 - SEK	11,4	-20,7	35,5	11,5	31,3	-4,8	9,7	8,9	5,7	14,5
Sverige 100 Index Criteria A9 - SEK	11,5	-20,6	35,7	11,6	31,5	-4,7	10,0	9,3	6,0	14,9
Sverige 100 Index Criteria A9 - NOK	16,9	-23,0	26,7	24,0	26,4	-6,8	15,9	-1,4	16,2	16,5
Sverige 100 Index Criteria B1 - SEK	11,4	-21,2	35,6	11,5	31,3	-4,8	9,7	8,9	5,7	14,5
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Sverige 100 Index Criteria A1 - SEK	11,4	-20,6	35,9	11,7	31,5	-4,6	10,0	9,2	6,1	15,0
Sverige 100 Index Criteria A9 - SEK	11,4	-20,6	35,9	11,7	31,5	-4,6	10,0	9,2	6,1	15,0
Sverige 100 Index Criteria A9 - NOK	16,9	-23,0	27,0	24,0	26,4	-6,8	16,0	-1,5	16,3	16,6
Sverige 100 Index Criteria B1 - SEK	11,4	-20,6	35,9	11,7	31,5	-4,6	10,0	9,2	6,1	15,0
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Sverige 100 Index Criteria A1 - SEK	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,0	0,1	0,0	0,0
Sverige 100 Index Criteria A9 - SEK	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,0	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria A9 - NOK	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,0	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria B1 - SEK	0,4	0,4	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Sverige 100 Index Criteria A1 - SEK	-0,4	3,7	22,9	21,0	11,8	2,2	9,3	7,3	10,0	19,6
Sverige 100 Index Criteria A9 - SEK	-0,3	3,8	23,1	21,1	12,0	2,4	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria A9 - NOK	-1,0	-1,2	25,4	25,2	8,5	4,0	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria B1 - SEK	-0,7	3,4	23,0	21,0	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	-0,3	3,9	23,2	21,2	12,0	2,4	9,6	7,6	10,5	20,2
NOK	-1,0	-1,1	25,5	25,2	8,5	4,0	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Sverige 100 Index Criteria A1 - SEK	9,9	8,4	15,7	10,8	9,6	6,6	12,6	13,8	-	-
Sverige 100 Index Criteria A9 - SEK	10,0	8,5	15,9	11,0	9,8	6,9	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria A9 - NOK	11,9	7,4	16,5	10,8	9,4	7,6	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria B1 - SEK	9,7	8,3	15,7	10,8	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	10,0	8,6	15,9	11,0	9,8	6,9	13,0	14,3	-	-
NOK	11,9	7,4	16,6	10,8	9,4	7,7	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %										
Sverige 100 Index Criteria A1 - SEK	10,8	10,5	14,8	-	-	-	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria A9 - SEK	11,0	10,7	15,0	-	-	-	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria A9 - NOK	12,1	11,8	16,3	-	-	-	-	-	-	-
Sverige 100 Index Criteria B1 - SEK	10,8	10,4	14,8	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	11,1	10,8	15,1	-	-	-	-	-	-	-
NOK	12,1	11,9	16,4	-	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK										
	5,01	5,31	5,64	-	-	-	-	-	-	-
Omräkningkurs NOK/SEK										
	1,01	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta - historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Sweden 100 Tradable

T o m 2019-10-06: OMXSB Gross Index

Fondens jämförelseindex utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se Information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.



Handelsbanken Sverige 100 Index Criteria, forts.

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 0,0**

	Underliggande exponering tSEK	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
OMX Stockholm 30 ESG Jul 2023	143 244	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>18 392 681</b>	<b>99,2</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		142 536	0,8
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>18 535 217</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

**Volym utlånade värdepapper, tSEK 1 264 844**

**Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar 6,9**

**De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:**

Amerikanska staten	482 863
Franska staten	225 350
Hsbc Holdings	32 788
Tyska staten	23 541
Brittiska staten	20 443
Mitsubishi Heavy Industries	18 382
Österrikiska staten	17 993
Belgiska staten	15 139
Finska staten	10 479
Nederländska staten	9 909

**De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:**

SEB	722 620
Morgan Stanley & Co. International	278 334
Barclays Capital Securities	96 121
BNP Paribas Arbitrage SNC	82 670
Goldman Sachs International	66 591
Citigroup Global Markets	55 535
UBS AG London Branch	45 808
Svenska Handelsbanken	18 607
Merrill Lynch International	13 827
HSBC Bank	5 449

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:**

Aktier	579 845
Obligationer och andra räntebärande instrument	805 717
	<b>1 385 562</b>

Vi godtar statsobligationer och statskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	792
En till tre månader	10 526
Tre månader till ett år	15 941
Mer än ett år	778 459
Obestämd löptid	579 845
	<b>1 385 562</b>

**Motparternas hemvist, tSEK**

Frankrike	82 670
Storbritannien	561 666
Sverige	741 226
	<b>1 385 562</b>

**Säkerheternas valuta, tSEK**

AUD	450
CHF	2 909
DKK	0
EUR	315 166
GBP	86 796
HKD	4 695
JPY	129 377
NZD	62
SEK	934
SGD	473
USD	844 701
	<b>1 385 562</b>

**Avveckling och clearing, tSEK**

Tredje part	1 385 562
	<b>1 385 562</b>

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 4 083 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- SEB
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende sponsrad, garanterad, godkänd, emitterad, marknadsförd, såld eller understödd på något annat sätt av Solactive AG (Solactive) och Solactive lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av dess index, index varumärke eller indexnivå kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. Indexet beräknas och publiceras av Solactive. Solactive gör sitt bästa för att se till att indexet beräknas korrekt. Oavsett skyldigheter gentemot fondens emittent har Solactive ingen skyldighet att påpeka fel i indexet till tredje part, inklusive men inte begränsat till investerare i fonden och/eller finansiella intermediärer i fonden. Varken offentliggörande av index eller licensiering av index eller index varumärke för användning i samband med fonden utgör någon rekommendation från Solactive att investera kapital i fonden, ej heller utgör det inte på något sätt en försäkring eller åsikt från Solactive avseende eventuella investeringar i denna fond.



# Handelsbanken Sverige Index Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet SIX Sweden SRI Index GI så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,2%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet består av samtliga bolag på Stockholmsbörsen, exklusive de bolag som inte uppfyller hållbarhetskraven. Det index som fonden följer innefattar hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven innebär att index väljer bort bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer samt bolag med produktion eller distribution av fossila bränslen, krigsmateriel, tobak, cannabis, alkohol, kommersiell spelverksamhet och pornografi. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 10,5% under första halvåret 2023\*. Fondens syfte är att efterbilda sammansättningen av index och fonden består av samtliga aktier som ingår i SIX Sweden SRI Index GI. Index adderar numera endast aktier vid två tillfällen per år, sista maj och sista november. Vid rebalanseringen i maj adderades Acrinova, Coinshares International, Embracer, Sampo SDB, Sedana Medical och Vestum. De tre största innehaven vid halvårsskiftet var Atlas Copco, Investor och Volvo. Index bestod vid halvårsskiftet av 346 aktier.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 5 av 7, dvs. en medelhög riskklass. Det betyder att fonden har medelhög risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Sverige. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Då fonden består av olika andelsklasser kan förändringar i valutakurser medföra att värdet och riskklassificeringen skiljer sig åt mellan olika andelsklasser beroende på vilken valuta andelsklassen handlas i. Fondens placeringar sker dock i företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra

tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0,8%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0,0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0,3%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

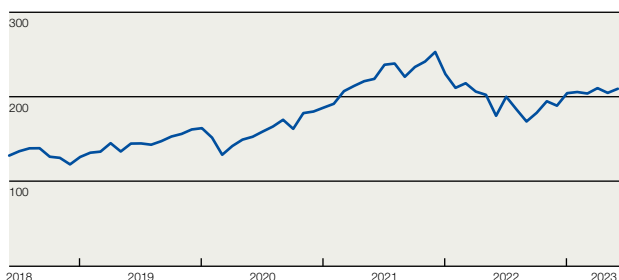
Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som

Handelsbanken Sverige Index Criteria, forts.

kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Sverige Index Criteria A1 - SEK	414,29	374,80	500,21	361,14	319,28	237,76	250,07	233,72	216,07	197,10
Sverige Index Criteria A9 - SEK	424,27	382,97	508,82	365,71	321,87	238,61	-	-	-	-
Sverige Index Criteria B1 - SEK	272,07	256,41	355,85	267,60	246,94	188,93	207,25	201,46	194,28	183,70
Fondens totala nettolöfde, mnSEK	4 016	2 314	1 819	-3 415	21 173	-638	565	353	474	-549
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	51 145	42 661	53 888	37 886	37 073	6 313	7 271	6 264	5 494	4 614
Sverige Index Criteria A1 - SEK	43 726	38 769	50 073	34 362	34 268	4 384	5 102	4 641	3 646	3 347
Sverige Index Criteria A9 - SEK	4 607	1 780	455	302	279	264	-	-	-	-
Sverige Index Criteria B1 - SEK	2 812	2 112	3 361	3 222	2 173	1 358	2 169	1 623	1 848	1 267
Antal andelar totalt, tusental	126 739	116 324	110 443	108 016	118 413	28 354	30 870	27 913	26 385	23 878
Sverige Index Criteria A1 - SEK	105 544	103 441	100 104	95 150	107 326	18 438	20 402	19 857	16 870	16 982
Sverige Index Criteria A9 - SEK	10 858	4 648	895	826	867	1 107	-	-	-	-
Sverige Index Criteria B1 - SEK	10 336	8 235	9 444	12 041	8 800	7 189	10 468	8 056	9 515	6 896
varav utelöpande andelsbevis, tusental	190	190	190	195	195	-	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Sverige Index Criteria A1 - SEK	10,5	-25,1	38,5	13,1	34,3	-4,9	7,0	8,2	9,6	16,2
Sverige Index Criteria A9 - SEK	10,8	-24,7	39,1	13,6	34,9	-4,5	7,5	8,7	10,1	16,8
Sverige Index Criteria B1 - SEK	10,4	-25,0	38,5	13,3	34,3	-4,9	7,0	8,2	9,6	16,2
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Sverige Index Criteria A1 - SEK	10,8	-24,6	39,1	13,8	35,1	-4,4	7,6	8,6	10,2	17,0
Sverige Index Criteria A9 - SEK	10,8	-24,6	39,1	13,8	35,1	-4,4	7,6	8,6	10,2	17,0
Sverige Index Criteria B1 - SEK	10,8	-24,6	39,1	13,8	35,1	-4,4	7,6	8,6	10,2	17,0
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Sverige Index Criteria A1 - SEK	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1
Sverige Index Criteria A9 - SEK	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	-	-	-	-
Sverige Index Criteria B1 - SEK	0,1	0,1	0,2	0,2	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1
Gemensnittlig årsavkastning 2 år, %										
Sverige Index Criteria A1 - SEK	-2,7	1,9	25,2	23,2	13,0	0,9	7,6	8,9	12,9	21,2
Sverige Index Criteria A9 - SEK	-2,2	2,3	25,7	23,8	13,5	1,3	-	-	-	-
Sverige Index Criteria B1 - SEK	-2,7	1,9	25,3	23,4	13,0	0,9	7,6	8,9	12,9	21,2
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	-2,1	2,4	25,8	24,0	13,6	1,4	8,1	9,4	13,6	22,0
Gemensnittlig årsavkastning 5 år, %										
Sverige Index Criteria A1 - SEK	9,9	8,4	16,4	10,8	10,1	7,0	13,3	15,6	9,8	13,3
Sverige Index Criteria A9 - SEK	10,4	8,9	17,0	11,3	10,6	7,5	-	-	-	-
Sverige Index Criteria B1 - SEK	9,9	8,5	16,5	10,9	10,1	7,0	13,3	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	10,5	9,0	17,1	11,4	10,7	7,6	13,9	16,3	10,5	14,1
Gemensnittlig årsavkastning 10 år, %										
Sverige Index Criteria A1 - SEK	11,0	10,8	16,0	10,3	11,7	13,4	8,1	6,8	8,5	-
Sverige Index Criteria A9 - SEK	11,5	11,3	16,5	10,8	12,2	13,9	-	-	-	-
Sverige Index Criteria B1 - SEK	11,0	10,9	-	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	11,6	11,4	16,7	11,0	12,4	14,0	8,8	7,5	9,3	-
Utdelning per andel, SEK	10,33	11,29	11,95	9,88	5,67	8,29	8,06	7,77	7,35	6,57

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta - historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: SIX Sweden SRI Index GI

T o m 2015-09-30: OMX GES Ethical Sweden Gross Index

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångsdrag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Sverige Index Criteria A1	0,65
Sverige Index Criteria A9	0,20
Sverige Index Criteria B1	0,65
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Sverige Index Criteria A1	0,65
Sverige Index Criteria A9	0,20
Sverige Index Criteria B1	0,65
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Sverige Index Criteria A1	0,68
Sverige Index Criteria A9	0,23
Sverige Index Criteria B1	0,68
Transaktionskostnader, tSEK	3 316
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,01

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,1
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	12,3
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk % - A1 SEK	22,5	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk % - A9 SEK	22,5	Informationskvot - A9 SEK	Negativ
Total risk % - B1 SEK	22,5	Informationskvot - B1 SEK	Negativ
Total risk i index % - A1 SEK	22,5	Sharpeknot - A1 SEK	-0,2
Total risk i index % - A9 SEK	22,5	Sharpeknot - A9 SEK	-0,1
Total risk i index % - B1 SEK	22,5	Sharpeknot - B1 SEK	-0,2
Jämförelseindex	SIX Sweden SRI Index GI	Sharpeknot i index - A1 SEK	-0,1
		Sharpeknot i index - A9 SEK	-0,1
Aktiv avkastning % - A1 SEK	-0,5	Sharpeknot i index - B1 SEK	-0,1
Aktiv avkastning % - A9 SEK	-0,1		
Aktiv avkastning % - B1 SEK	-0,5		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt ätagandemetoden





Handelsbanken Sverige Index Criteria, forts.

Övriga finansiella instrument			0,0
	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>ONOTERADE AKTIER</b>			
SVERIGE			
Precise Biometrics BTA	166 920	209	0,0
Rizzo Group BTA B	5 716 931	445	0,0
Starbreeze BTA B	3 252 809	2 853	0,0
		<b>3 506</b>	<b>0,0</b>
<b>Onoterade aktier</b>		<b>3 506</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>50 811 422</b>	<b>99,3</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		333 321	0,7
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>51 144 743</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

#### Uppgifter om fondens värdepapperslån

**Volym utlånade värdepapper, tSEK** **3 572 842**

**Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar** **7,0**

#### De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:

Amerikanska staten	1 204 783
Franska staten	700 169
Brittiska staten	98 050
Hsbc Holdings	95 403
Tyska staten	61 627
Mitsubishi Heavy Industries	45 940
Nederländska staten	32 113
Glencore	29 996
Denbury	27 260
Asana	26 923

#### De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:

SEB	1 947 417
Morgan Stanley & Co. International	718 720
BNP Paribas Arbitrage SNC	233 617
UBS AG London Branch	224 768
J.P. Morgan Securities	188 583
Merrill Lynch International	180 057
Goldman Sachs International	169 964
Citigroup Global Markets	112 935
Barclays Capital Securities	96 717
Svenska Handelsbanken	59 404

#### Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:

Aktier	1 801 788
Obligationer och andra räntebärande instrument	2 140 366
	<b>3 942 154</b>

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

#### Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	1 567
En till tre månader	8 938
Tre månader till ett år	37 593
Mer än ett år	2 092 269
Obestämd löptid	1 801 788
	<b>3 942 154</b>

#### Motparternas hemvist, tSEK

Frankrike	233 617
Storbritannien	1 701 717
Sverige	2 006 821
	<b>3 942 154</b>

#### Säkerheternas valuta, tSEK

AUD	4 125
CHF	14 565
DKK	15 716
EUR	907 811
GBP	414 545
HKD	31 892
JPY	199 863
NZD	545
SEK	16 305
SGD	2 477
USD	2 334 312
	<b>3 942 154</b>

#### Avveckling och clearing, tSEK

Tredje part	3 942 154
	<b>3 942 154</b>

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

#### Uppgifter om avkastning och kostnad:

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 27 100 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

#### Motparter för värdepappersutlåning under året:

- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- SEB
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fysiska fondandelsbevis i Sverige Index Criteria ska lösas in. Vissa andelsägare i Sverige Index Criteria har så kallade fysiska andelsbevis (innehavarpapper) i stället för fondkonto. Bevisen är utställda av "Öppna Aktiefonden Koncentra". Enligt lagen om värdepappersfonder ska alla sådana andelsbevis lösas in och fondandelarna i stället registreras. Eftersom det inte finns något register över de andelsägare som har dessa andelsbevis, måste vi uppmana er som har sådana att själva söka upp något av bankens kontor för att få dem registrerade.

Fonden är inte i något avseende garanterad, godkänd, emitterad eller understödd av SIX Telex AB ("SIX") och SIX lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av SIX Sweden SRI Index GI kan ge upphov till eller med avseende på värdet av SIXRX vid viss tidpunkt. SIX skall i intet fall vara ansvarig för fel i SIX Sweden SRI Index GI. SIX skall ej heller vara skyldig att meddela eller offentliggöra eventuella fel i SIX Sweden SRI Index GI. Alla rättigheter till varumärket SIXRX tillhör SIX och används enligt licens från SIX.





# Handelsbanken USA Index Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned US Index NTR så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet kommer att efterbildas genom optimerad fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i ett större urval av de aktier som ingår i indexet. Fonden kan även vara investerad i samtliga aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,2%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Index är återinvesterande, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet, justerat för skatt. Indexet består av stora och medelstora amerikanska bolag på Amerikanska börserna exklusive de bolag som ej uppfyller indexets hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven i indexet syftar till en minskning av koldioxidutsläppen och bolagen i index väljs ut och viktas på så sätt att indexportföljens utsläpp av växthusgaser anpassas till de långsiktiga globala uppvärmningsmålen i Parisavtalet. Hållbarhetskraven i index innebär vidare att bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer, bolag som avsevärt skadar miljömässiga mål samt bolag som är verksamma inom kontroversiella sektorer inte ingår i index. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 22,4% under första halvåret 2023\*. Fonden består av ca 400 bolag och de tre största aktieinnehaven vid halvårsskiftet var Apple, Microsoft och Alphabet. De tre största sektorerna var IT, Hälsovård samt Finans. Fonden följer ett index som är i linje med Parisavtalets klimatmål så kallat EU Paris Aligned Benchmarks. Denna utveckling är ett viktigt steg på vägen att nå fondbolagets mål om nettonollutsläpp i våra portföljer till år 2040 samt att linjera allt vårt förvaldade kapital i enlighet med Parisavtalets målsättningar.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till den nordamerikanska aktiemarknaden. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker dock i företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Då fondens investeringar sker i utländska aktier denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. Då fonden består av olika andelsklasser kan förändringar i valutakurser medföra att värdet och riskklassificeringen skiljer sig åt mellan olika andelsklasser beroende på vilken valuta andelsklassen handlas i. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde,

hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0,9%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0,2%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0,5%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans



## Handelsbanken USA Index Criteria, forts.

EUR	14,0	12,1	17,6	13,5	13,2	11,9	17,1	18,7	-	-
NOK	18,8	13,6	19,9	15,5	15,1	15,8	24,2	22,5	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %										
USA Index Criteria A1 - SEK	17,9	17,4	19,6	-	-	-	-	-	-	-
USA Index Criteria A1 - EUR	14,5	14,4	17,9	-	-	-	-	-	-	-
USA Index Criteria A1 - NOK	19,0	18,6	21,0	-	-	-	-	-	-	-
USA Index Criteria A9 - SEK	18,1	17,7	19,9	-	-	-	-	-	-	-
USA Index Criteria A9 - EUR	14,7	14,6	18,2	-	-	-	-	-	-	-
USA Index Criteria A9 - NOK	19,2	18,8	21,2	-	-	-	-	-	-	-
USA Index Criteria B1 - SEK	17,9	17,4	-	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %										
SEK	18,1	17,6	19,9	-	-	-	-	-	-	-
EUR	14,7	14,6	18,1	-	-	-	-	-	-	-
NOK	19,2	18,8	21,2	-	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK	15,88	16,29	13,89	14,14	9,07	9,07	8,60	7,49	7,12	5,42
Omräkningkurs EUR/SEK	11,78	11,12	10,30	10,05	10,51	10,13	9,83	9,58	9,16	-
Omräkningkurs NOK/SEK	1,01	1,06	1,03	0,96	1,07	1,02	1,00	1,06	0,95	-

Historiskt kan fonden ha flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta – historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser. 1) En justering har gjorts under 2023, vilket förklarar varför avkastningen mellan andelsklasserna skiljer sig åt. Justeringen påverkar inte det faktiska värdet i andelsklasserna.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned USA Index

T o m 2017-05-31: MSCI USA Index  
T o m 2019-04-30: MSCI USA Select Global Norms Ex Controversial Business  
T o m 2021-05-20: Solactive ISS ESG Screened USA

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser		
USA Index Criteria A1	0,20	
USA Index Criteria A9	0,10	
USA Index Criteria B1	0,20	
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet		
USA Index Criteria A1	0,20	
USA Index Criteria A9	0,10	
USA Index Criteria B1	0,20	
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %		
USA Index Criteria A1	0,20	
USA Index Criteria A9	0,10	
USA Index Criteria B1	0,20	
Transaktionskostnader, tSEK	3 901	
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,01	

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,3
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	0,0
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått \*

Total risk % - A1 SEK	15,6	Aktiv avkastning % - B1 SEK	0,0
Total risk % - A1 EUR	17,0	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk % - A1 NOK	14,2	Informationskvot - A1 EUR	Negativ
Total risk % - A9 SEK	15,6	Informationskvot - A1 NOK	Negativ
Total risk % - A9 EUR	17,0	Informationskvot - A9 SEK	2,9
Total risk % - A9 NOK	14,2	Informationskvot - A9 EUR	2,7
Total risk % - B1 SEK	15,6	Informationskvot - A9 NOK	2,9
Total risk i index % - A1 SEK	15,6	Informationskvot - B1 SEK	0,0
Total risk i index % - A1 EUR	17,0	Sharpekvot - A1 SEK	0,8
Total risk i index % - A1 NOK	14,2	Sharpekvot - A1 EUR	0,3
Total risk i index % - A9 SEK	15,6	Sharpekvot - A1 NOK	0,8
Total risk i index % - A9 EUR	17,0	Sharpekvot - A9 SEK	0,8
Total risk i index % - A9 NOK	14,2	Sharpekvot - A9 EUR	0,3
Total risk i index % - B1 SEK	15,6	Sharpekvot - A9 NOK	0,8
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned USA Index	Sharpekvot - B1 SEK	0,8
Aktiv avkastning % - A1 SEK	0,0	Sharpekvot i index - A1 SEK	0,8
Aktiv avkastning % - A1 EUR	0,0	Sharpekvot i index - A1 EUR	0,3
Aktiv avkastning % - A1 NOK	0,0	Sharpekvot i index - A1 NOK	0,8
Aktiv avkastning % - A9 SEK	0,1	Sharpekvot i index - A9 SEK	0,8
Aktiv avkastning % - A9 EUR	0,1	Sharpekvot i index - A9 EUR	0,3
Aktiv avkastning % - A9 NOK	0,1	Sharpekvot i index - A9 NOK	0,8
		Sharpekvot i index - B1 SEK	0,8

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	53 234 908	99,7	42 224 032	99,5
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde<sup>Not 1)</sup></b>	<b>53 234 908</b>	<b>99,7</b>	<b>42 224 032</b>	<b>99,5</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	-258 900	-0,5	176 552	0,4
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	29 460	0,1	32 282	0,1
Övriga tillgångar	780 196	1,5	-	-
<b>Summa tillgångar</b>	<b>53 785 664</b>	<b>100,8</b>	<b>42 432 866</b>	<b>100,0</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	7 879	0,0	6 650	0,0
Övriga skulder	395 434	0,7	-	-
<b>Summa skulder</b>	<b>403 312</b>	<b>0,8</b>	<b>6 650</b>	<b>0,0</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>53 382 352</b>	<b>100,0</b>	<b>42 426 216</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	635 237	1,2	846 027	2,0
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	701 075	1,3	944 265	2,2
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	8 825	0,0	12 452	0,0

1) Likvida medel 8 825 tSEK

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES** **99,7**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>BERMUDA</b>			
Arch Capital Group	191	154	0,0
		<b>154</b>	<b>0,0</b>
<b>IRLAND</b>			
Accenture	93 045	310 125	0,6
Aon	17 302	64 512	0,1
Delphi Automotive	90 013	99 258	0,2
Horizon Therapeutics	22 129	24 583	0,0
Johnson Controls	114 999	84 639	0,2
Linde	92 891	382 354	0,7
Medtronic	272 717	259 516	0,5
Seagate Technology Holdings	2 776	1 855	0,0
Steris Ord Shs	7 277	17 684	0,0
Trane Technologies	121	250	0,0
		<b>1 244 777</b>	<b>2,3</b>
<b>ISRAEL</b>			
Mobileye Global A	14 464	6 002	0,0
		<b>6 002</b>	<b>0,0</b>
<b>KANADA</b>			
Lululemon Athletica	33 566	137 228	0,3
		<b>137 228</b>	<b>0,3</b>
<b>LUXEMBURG</b>			
Spotify Technology	4 223	7 323	0,0
		<b>7 323</b>	<b>0,0</b>
<b>SCHWEIZ</b>			
Chubb	60 159	125 125	0,2
Garmin	15 880	17 888	0,0
TE Connectivity	70 148	106 198	0,2
		<b>249 211</b>	<b>0,5</b>





Handelsbanken USA Index Criteria, forts.

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

### Sammanställning, företags- och koncernexponeringar\*

Företag/koncern	% av fondförmögenheten	Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Alphabet	4,2	Lennar Corporation	0,1

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehar mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

#### Uppgifter om fondens värdepapperslån

**Volym utlånade värdepapper, tSEK** **635 237**

**Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar** **1,2**

#### De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:

Amerikanska staten	97 327
Franska staten	42 144
Brittiska staten	36 736
Nvidia	12 971
Genuine Parts	10 493
Deere & Co	10 321
Starbucks	10 175
Keysight Technologies	9 132
Abbvie	8 855
Lockheed Martin	8 854

#### De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:

Barclays Bank	326 346
UBS AG London Branch	245 092
SEB	91 713
Merrill Lynch International	17 674
Morgan Stanley & Co. International	16 720
J.P. Morgan Securities	3 530

#### Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:

Obligationer och andra räntebärande instrument	189 530
Aktier	511 546
<b>701 075</b>	

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

#### Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	1 511
En till tre månader	1 897
Tre månader till ett år	3 773
Mer än ett år	182 349
Obestämd löptid	511 546
<b>701 075</b>	

#### Motparternas hemvist, tSEK

Storbritannien	609 362
Sverige	91 713
<b>701 075</b>	

#### Säkerheternas valuta, tSEK

AUD	3 857
CHF	8
DKK	0
EUR	56 933
GBP	50 101
HKD	0
JPY	66 689
USD	523 487
<b>701 075</b>	

#### Avveckling och clearing, tSEK

Tredje part	701 075
<b>701 075</b>	

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

#### Uppgifter om avkastning och kostnad:

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 1 245 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

#### Motparter för värdepappersutlåning under året:

-Barclays Bank  
 -HSBC Bank  
 -Merrill Lynch International  
 -Morgan Stanley & Co Intl  
 -SEB  
 -UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende sponsrad, garanterad, godkänd, emitterad, marknadsförd, såld eller understödd på något annat sätt av Solactive AG (Solactive) och Solactive lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av dess index, index varumärke eller indexnivå kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. Indexet beräknas och publiceras av Solactive. Solactive gör sitt bästa för att se till att indexet beräknas korrekt. Oavsett skyldigheter gentemot fondens emittent har Solactive ingen skyldighet att påpeka fel i indexet till tredje part, inklusive men inte begränsat till investerare i fonden och/eller finansiella intermediärer i fonden. Varken offentliggörande av index eller licensiering av index eller index varumärke för användning i samband med fonden utgör någon rekommendation från Solactive att investera kapital i fonden, ej heller utgör det inte på något sätt en försäkring eller åsikt från Solactive avseende eventuella investeringar i denna fond.



# Handelsbanken Auto 25 Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en regelstyrd blandfond med en målsättning att erbjuda en förutbestämd allokering. Fonden är passivt förvaltd. Fonden placerar i 25% aktiefonder och 75% i fonder med exponering mot svensk räntemarknad (målvikter). Fondens avkastning bestäms av hur de aktie- och räntefonder som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Aktiedelen ska i sin tur fördelas med 50% global aktiemarknad och 50% nordisk aktiemarknad. Målvikterna rebalanseras kvartalsvis såvida inte innehaven avviker från målvikten med mer än +/- 2,5 procentenheter. I sådant fall rebalanseras vikterna direkt. Fonden placerar till minst 90% i fonder inom Handelsbanken. De aktieindex som är styrande för aktieexponeringen är Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (10%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (2,5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (2,5%) och Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (10%). De ränteindex som är styrande för ränteeponeringen är Handelsbanken Sweden All Bond Tradable Index (37,5%), OMRXTBILL (28,125%) och OMRX Mortgage Bond 1-3 y Index (9,375%). Fonden är en specialfond, vilket för denna fond innebär att den avviker från en värdepappersfond genom att den kan ha stora innehav i enskilda fonder. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 3,7% under första halvåret 2023\*. De största innehaven i fonden är Handelsbanken Kortrränta SEK och XACT Obligation.

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en blandfond som är riskklassificerad med 2 av 7, dvs. en låg riskklass. Det betyder att fonden har låg risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Riskerna i fonden beror på fondens fördelning mellan tillgångsslagen aktier och räntor. En investering i aktier och aktiefonder är normalt förenade med hög risk och kan variera kraftigt över tid. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är förenad med

ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindingstid har en högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindingstid. Räntebindingstiden på innehaven i fonden kan variera väsentligt över tid.

Fonden har möjlighet att placera koncentrerat både avseende region och sektor. Detta innebär att risken i fonden kan vara högre än en investering i en diversifierad global fond som fördelar sina investeringar över flera regioner eller sektorer. Då fondens investeringar sker i utländska värdepapper denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden får placera i derivat och kan göra det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall mycket begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

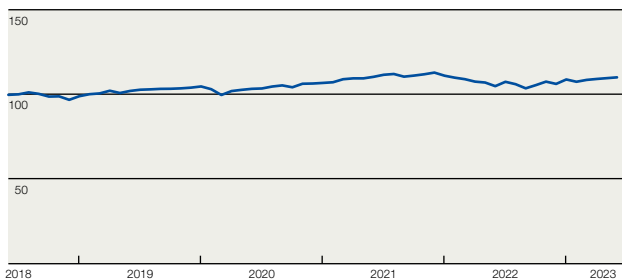
Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort), inval av underliggande fonder baserat på hållbarhetsanalys, samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning i underliggande fonder.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

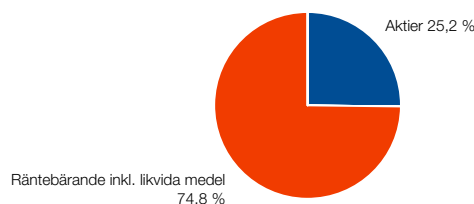
- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

## Marknadsexponering\*



\* Fondens placeringsfördelning inom marknaderna per 2023-06-30, i förhållande till fondens totala tillgångar vid detta datum.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK	110,13	106,25	112,94	106,48	104,04	96,85	-	-	-	-
Fondens totala nettovärde, mnSEK	105	81	349	207	312	35	-	-	-	-
Fondförmögenhet, mnSEK	1 126	984	962	571	353	34	-	-	-	-
Antal andelar, tusental	10 227	9 260	8 522	5 359	3 397	348	-	-	-	-
Total avkastning i %	3,7	-5,9	6,1	2,3	7,4	-3,1	-	-	-	-

Handelsbanken Auto 25 Criteria, forts.

Jämförelseindex inklusive utdelning i %	3,7	-5,4	6,5	2,5	-	-	-	-	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	0,2	0,1	0,2	-	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	-0,1	-0,1	4,2	4,9	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	0,3	0,4	4,5	-	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	2,0	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (10%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (2,5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (10%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (2,5%), SHB Sweden All Bond Tradable Index (37,5%), OMRX Treasury Bill Index (28,125%), OMRX Mortgage Bond 1-3 y Index (9,375%)

T o m 2020-05-10: SIX SRI Nordic Index NI (10%), SHB Nordic Smart Beta Index (2,5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (10%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (2,5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (37,5%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (37,5%).

T o m 2020-06-16: SIX SRI Nordic Index NI (10%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (2,5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (10%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (2,5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (37,5%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (37,5%).

T o m 2021-05-20: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (10%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (2,5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (10%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (2,5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (37,5%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (37,5%).

T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (10%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (2,5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (10%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (2,5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (37,5%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (37,5%).

T o m 2021-08-31: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (10%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (2,5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (10%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (2,5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (37,5%), SHB Sweden All Bond Tradable Index (37,5%).

T o m 2022-06-30: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (10%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (2,5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (2,5%) och Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (10%), Handelsbanken Sweden All Bond Tradable Index (37,5%), OMRXTBILL (37,5%).

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevantt branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,60
Transaktionskostnader, tSEK	26
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,01

Högst 3 % får tas ut i årlig fast avgift för förvaltningen av de underliggande fonder som fonden placerar medel i. Eventuellt förekommande prestationsbaserad förvaltningsavgift i de underliggande fonderna får på respektive mätperiod högst uppgå till 30 % av överavkastningen i förhållande till respektive fonds jämförelsenorm (index eller motsvarande)

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,1
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	37,5
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk %	4,9	Aktiv avkastning %	-0,4
Total risk i index %	4,9	Informationskvot	Negativ
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (10%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (2,5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (10%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (2,5%), SHB Sweden All Bond Tradable Index (37,5%), OMRX Treasury Bill Index (28,125%), OMRX Mortgage Bond 1-3 y Index (9,375%)	Sharpekvot	-0,2
		Sharpekvot i index	-0,1

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.  
De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Fondandelar	1 125 701	100,0	982 797	99,9
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>1 125 701</b>	<b>100,0</b>	<b>982 797</b>	<b>99,9</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	3 303	0,3	3 644	0,4
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	181	0,0	158	0,0
Övriga tillgångar	1 032	0,1	2 939	0,3
<b>Summa tillgångar</b>	<b>1 130 217</b>	<b>100,4</b>	<b>989 537</b>	<b>100,6</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	552	0,0	501	0,1
Övriga skulder	3 405	0,3	5 162	0,5
<b>Summa skulder</b>	<b>3 957</b>	<b>0,4</b>	<b>5 663</b>	<b>0,6</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>1 126 260</b>	<b>100,0</b>	<b>983 874</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 39,8**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
<b>BÖRSHANDLADE AKTIEFONDER</b>			
XACT Norden Högutdelande (UCITS ETF)	215 912	27 754	2,5
		27 754	2,5
<b>BÖRSHANDLADE RÄNTEFONDER</b>			
XACT Obligation (UCITS ETF)	4 401 723	420 426	37,3
		420 426	37,3
<b>Fondandelar</b>		<b>448 180</b>	<b>39,8</b>

**Övriga finansiella instrument 60,2**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
<b>AKTIEFONDER</b>			
SHB Global Index Criteria (A1 SEK)	249 795	116 123	10,3
SHB Global Småbolag Index Criteria (A1 SEK)	180 403	29 812	2,6
SHB Norden Index Criteria (A1 SEK)	629 947	111 480	9,9
		257 415	22,9
<b>RÄNTEFONDER</b>			
SHB Kortränta SEK (A1 SEK)	3 947 430	420 106	37,3
		420 106	37,3
<b>Fondandelar</b>		<b>677 521</b>	<b>60,2</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>1 125 701</b>	<b>100,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		559	0,0
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>1 126 260</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

## Uppgifter om fondens värdepapperslån

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

## Uppgifter om avkastning och kostnad:

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 1 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.





# Handelsbanken Auto 50 Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en regelstyrd blandfond med en målsättning att erbjuda en förutbestämd allokering. Fonden är passivt förvaltd. Fonden placerar i 50% aktiefonder och 50% i fonder med exponering mot svensk räntemarknad (målvikter). Fondens avkastning bestäms av hur de aktie- och räntefonder som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Aktiedelen ska i sin tur fördelas med 50% global aktiemarknad och 50% nordisk aktiemarknad. Målvikterna rebalanseras kvartalsvis såvida inte innehaven avviker från målvikten med mer än +/- 2,5 procentenheter. I sådant fall rebalanseras vikterna direkt. Fonden placerar till minst 90% i fonder inom Handelsbanken. De aktieindex som är styrande för aktieexponeringen är Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (20%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (5%) och Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (20%). De ränteindex som är styrande för ränteexponeringen är Handelsbanken Sweden All Bond Tradable Index (25%), OMRXTBILL (18,75%) och OMRX Mortgage Bond 1-3 y Index (6,25%). Fonden är en specialfond, vilket för denna fond innebär att den avviker från en värdepappersfond genom att den kan ha stora innehav i enskilda fonder. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 6,7% under första halvåret 2023\*. De största innehaven i fonden är Handelsbanken Kortränta SEK och XACT Obligation.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en blandfond som är riskklassificerad med 3 av 7, dvs. en medellåg riskklass. Det betyder att fonden har medellåg risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Riskerna i fonden beror på fondens fördelning mellan tillgångsslagen aktier och räntor. En investering i aktier och aktiefonder är normalt förenade med hög risk och kan variera kraftigt över

tid. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är förenad med ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindingstid har en högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindingstid. Räntebindingstiden på innehaven i fonden kan variera väsentligt över tid. Fonden har möjlighet att placera koncentrerat både avseende region och sektor. Detta innebär att risken i fonden kan vara högre än en investering i en diversifierad global fond som fördelar sina investeringar över flera regioner eller sektorer. Då fondens investeringar sker i utländska värdepapper denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden får placera i derivat och kan göra det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall mycket begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

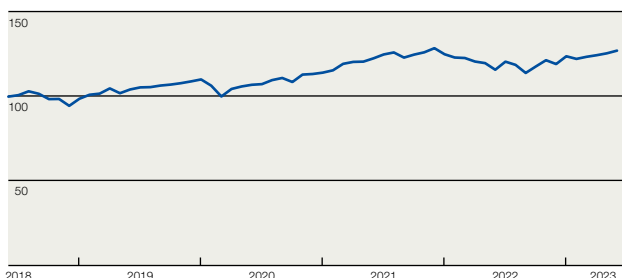
Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort), inval av underliggande fonder baserat på hållbarhetsanalys, samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning i underliggande fonder.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

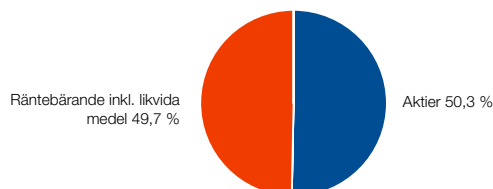
- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Marknadsexponering\*



\* Fondens placeringsfördelning inom marknaderna per 2023-06-30, i förhållande till fondens totala tillgångar vid detta datum.

Handelsbanken Auto 50 Criteria, forts.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Auto 50 Criteria A1 - SEK	127,01	119,07	128,47	113,21	108,81	94,38	-	-	-	-
Auto 50 Criteria B1 - SEK	99,98	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	385	279	669	593	416	58	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	2 670	2 133	2 004	1 140	495	55	-	-	-	-
Auto 50 Criteria A1 - SEK	2 651	2 133	2 004	1 140	495	55	-	-	-	-
Auto 50 Criteria B1 - SEK	19	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	21 057	17 917	15 596	10 073	4 547	586	-	-	-	-
Auto 50 Criteria A1 - SEK	20 871	17 917	15 596	10 073	4 547	586	-	-	-	-
Auto 50 Criteria B1 - SEK	186	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Auto 50 Criteria A1 - SEK	6,7	-7,3	13,5	4,0	15,3	-5,6	-	-	-	-
Auto 50 Criteria B1 - SEK	6,7	-7,3	13,5	4,0	15,3	-	-	-	-	-
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Auto 50 Criteria A1 - SEK	6,7	-6,9	14,1	4,3	-	-	-	-	-	-
Auto 50 Criteria B1 - SEK	6,7	-6,9	14,1	4,3	-	-	-	-	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Auto 50 Criteria A1 - SEK	0,1	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-
Auto 50 Criteria B1 - SEK	0,1	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Auto 50 Criteria A1 - SEK	1,8	2,6	8,7	9,5	-	-	-	-	-	-
Auto 50 Criteria B1 - SEK	1,9	2,6	8,7	9,5	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	2,2	3,1	9,1	-	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Auto 50 Criteria A1 - SEK	4,9	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Auto 50 Criteria B1 - SEK	4,9	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK	2,93	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (20%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (20%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (5%), SHB Sweden All Bond Tradable Index (25%), OMRX Treasury Bill Index (18,75%), OMRX Mortgage Bond 1-3 y Index (6,25%).

T o m 2020-05-10: SIX SRI Nordic Index NI (20%), SHB Nordic Smart Beta Index (5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (20%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (25%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (25%).

T o m 2020-06-16: SIX SRI Nordic Index NI (20%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (20%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (25%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (25%).

T o m 2021-05-20: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (20%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (20%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (25%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (25%).

T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (20%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (20%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (25%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (25%).

T o m 2021-08-31: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (20%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (20%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (25%), SHB Sweden All Bond Tradable Index (25%).

T o m 2022-06-30: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (20%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (20%), Handelsbanken Sweden All Bond Tradable Index (25%), OMRXTBILL (25%).

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd. För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Auto 50 Criteria A1	0,60
Auto 50 Criteria B1	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Auto 50 Criteria A1	0,60
Auto 50 Criteria B1	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Auto 50 Criteria A1	0,60
Auto 50 Criteria B1	0,60
Transaktionskostnader, tSEK	68
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,01
Högst 3 % får tas ut i årlig fast avgift för förvaltningen av de underliggande fonder som fonden placerar medel i. Eventuellt förekommande prestationsbaserad förvaltningsavgift i de underliggande fonderna får på respektive mätperiod högst uppgå till 30 % av övervakningen i förhållande till respektive fonds jämförelsenorm (index eller motsvarande)	

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,1
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	34,5
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått \*

Total risk % - A1 SEK	8,0	Aktiv avkastning % - A1 SEK	-0,4
Total risk % - B1 SEK	8,0	Aktiv avkastning % - B1 SEK	-0,4
Total risk i index % - A1 SEK	8,0	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk i index % - B1 SEK	8,0	Informationskvot - B1 SEK	Negativ
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (20%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (20%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (5%), SHB Sweden All Bond Tradable Index (25%), OMRX Treasury Bill Index (18,75%), OMRX Mortgage Bond 1-3 y Index (6,25%).	Sharpekvot - A1 SEK	0,1
		Sharpekvot - B1 SEK	0,1
		Sharpekvot i index - A1 SEK	0,2
		Sharpekvot i index - B1 SEK	0,2

\* Riskskiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten. De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Fondandelar	2 668 125	99,9	2 132 266	99,9
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>2 668 125</b>	<b>99,9</b>	<b>2 132 266</b>	<b>99,9</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	5 251	0,2	3 734	0,2
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	577	0,0	477	0,0
Övriga tillgångar	2 840	0,1	3 268	0,2
<b>Summa tillgångar</b>	<b>2 676 793</b>	<b>100,3</b>	<b>2 139 746</b>	<b>100,3</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	1 294	0,0	1 099	0,1
Övriga skulder	5 990	0,2	5 270	0,2
<b>Summa skulder</b>	<b>7 284</b>	<b>0,3</b>	<b>6 369</b>	<b>0,3</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>2 669 509</b>	<b>100,0</b>	<b>2 133 377</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	-	-	14	0,0
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	-	-	15	0,0

Handelsbanken Auto 50 Criteria, forts.

**Fondens innehav av finansiella instrument****Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 29,6**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
BÖRSHANDLADE AKTIEFONDER			
XACT Norden Högutdelande (UCITS ETF)	1 009 720	129 793	4,9
		<b>129 793</b>	<b>4,9</b>
BÖRSHANDLADE RÄNTEFONDER			
XACT Obligation (UCITS ETF)	6 916 639	660 635	24,7
		<b>660 635</b>	<b>24,7</b>
<b>Fondandelar</b>		<b>790 428</b>	<b>29,6</b>

**Övriga finansiella instrument 70,3**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
AKTIEFONDER			
SHB Global Index Criteria (A1 SEK)	1 172 214	544 930	20,4
SHB Global Småbolag Index Criteria (A1 SEK)	828 491	136 911	5,1
SHB Norden Index Criteria (A1 SEK)	3 029 794	536 175	20,1
		<b>1 218 016</b>	<b>45,6</b>
RÄNTEFONDER			
SHB Kortränta SEK (A1 SEK)	6 198 538	659 680	24,7
		<b>659 680</b>	<b>24,7</b>
<b>Fondandelar</b>		<b>1 877 696</b>	<b>70,3</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>2 668 125</b>	<b>99,9</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		1 384	0,1
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>2 669 509</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

Vi godtar statsobligationer och statskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 3 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

-Merrill Lynch International  
-Svenska Handelsbanken



# Handelsbanken Auto 75 Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en regelstyrd blandfond med en målsättning att erbjuda en förutbestämd allokering. Fonden är passivt förvaltd. Fonden placerar i 75% aktiefonder och 25% i fonder med exponering mot svensk räntemarknad (målvikter). Fondens avkastning bestäms av hur de aktie- och räntefonder som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Aktiedelen ska i sin tur fördelas med 50% global aktiemarknad och 50% nordisk aktiemarknad. Målvikterna rebalanseras kvartalsvis såvida inte innehaven avviker från målvikten med mer än +/- 2,5 procentenheter. I sådant fall rebalanseras vikterna direkt. Fonden placerar till minst 90% i fonder inom Handelsbanken. De aktieindex som är styrande för aktieexponeringen är Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (30%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (7,5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (7,5%) och Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (30%). De ränteindex som är styrande för räntexponeringen är Handelsbanken Sweden All Bond Tradable Index (12,5%), OMRXTBILL (9,375%) och OMRX Mortgage Bond 1-3 y Index (3,125%). Fonden är en specialfond, vilket för denna fond innebär att den avviker från en värdepappersfond genom att den kan ha stora innehav i enskilda fonder. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 9,7% under första halvåret 2023\*.

De största innehaven i fonden är Handelsbanken Norden Index Criteria och Handelsbanken Global Index Criteria.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en blandfond som är riskklassificerad med 3 av 7, dvs. en medellåg riskklass. Det betyder att fonden har medellåg risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Risken i fonden beror på fondens fördelning mellan tillgångsslagen aktier och räntor. En investering i aktier och aktiefonder är normalt förenade med hög risk och kan variera kraftigt över

tid. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är förenad med ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindningstid har en högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindningstid. Räntebindningstiden på innehaven i fonden kan variera väsentligt över tid. Fonden har möjlighet att placera koncentrerat både avseende region och sektor. Detta innebär att risken i fonden kan vara högre än en investering i en diversifierad global fond som fördelar sina investeringar över flera regioner eller sektorer. Då fondens investeringar sker i utländska värdepapper denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden får placera i derivat och kan göra det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall mycket begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

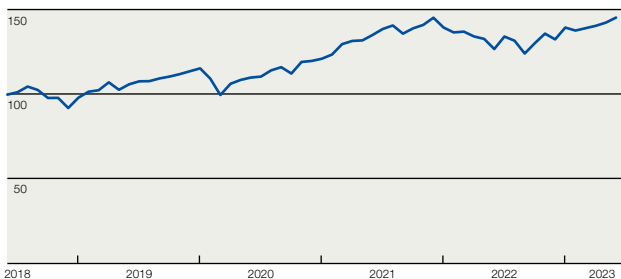
Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort), inval av underliggande fonder baserat på hållbarhetsanalys, samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning i underliggande fonder.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

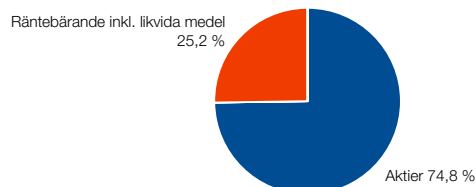
- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Marknadsexponering\*



\* Fondens placeringsfördelning inom marknaderna per 2023-06-30, i förhållande till fondens totala tillgångar vid detta datum.

Handelsbanken Auto 75 Criteria, forts.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Auto 75 Criteria A1 - SEK	145,20	132,34	145,13	119,61	113,53	91,80	-	-	-	-
Auto 75 Criteria B1 - SEK	101,12	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	355	312	422	312	238	22	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	1 912	1 407	1 203	614	275	20	-	-	-	-
Auto 75 Criteria A1 - SEK	1 909	1 407	1 203	614	275	20	-	-	-	-
Auto 75 Criteria B1 - SEK	3	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	13 177	10 630	8 287	5 134	2 425	221	-	-	-	-
Auto 75 Criteria A1 - SEK	13 144	10 630	8 287	5 134	2 425	221	-	-	-	-
Auto 75 Criteria B1 - SEK	33	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Auto 75 Criteria A1 - SEK	9,7	-8,8	21,3	5,3	23,7	-8,2	-	-	-	-
Auto 75 Criteria B1 - SEK	9,8	-8,8	21,3	5,3	23,7	-	-	-	-	-
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Auto 75 Criteria A1 - SEK	9,8	-8,5	22,1	5,8	-	-	-	-	-	-
Auto 75 Criteria B1 - SEK	9,8	-8,5	22,1	5,8	-	-	-	-	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Auto 75 Criteria A1 - SEK	0,1	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-
Auto 75 Criteria B1 - SEK	0,1	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Auto 75 Criteria A1 - SEK	3,7	5,2	13,1	14,1	-	-	-	-	-	-
Auto 75 Criteria B1 - SEK	3,8	5,2	13,1	14,1	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	4,1	5,7	13,6	-	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Auto 75 Criteria A1 - SEK	7,8	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Auto 75 Criteria B1 - SEK	7,8	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK	2,89	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (30%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (7,5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (30%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (7,5%), SHB Sweden All Bond Tradable Index (12,5%), OMRX Treasury Bill Index (9,375%), OMRX Mortgage Bond 1-3 y Index (3,125%).

T o m 2020-05-10: SIX SRI Nordic Index NI (30%), SHB Nordic Smart Beta Index (7,5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (30%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (7,5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (12,5%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (12,5%).

T o m 2020-06-16: SIX SRI Nordic Index NI (30%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (7,5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (30%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (7,5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (12,5%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (12,5%).

T o m 2021-05-20: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (30%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (7,5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (30%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (7,5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (12,5%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (12,5%).

T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (30%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (7,5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (30%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (7,5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (12,5%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (12,5%).

T o m 2021-08-31: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (30%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (7,5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (30%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (7,5%) och styrande för räntexponeringen är OMRX Treasury Bill Index (12,5%) och SHB Sweden All Bond Tradable Index (12,5%).

T o m 2022-06-30: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (30%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (7,5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (30%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (7,5%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (30%), Handelsbanken Sweden All Bond Tradable Index (12,5%), OMRX TBILL (12,5%).

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd. För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Auto 75 Criteria A1	0,60
Auto 75 Criteria B1	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Auto 75 Criteria A1	0,60
Auto 75 Criteria B1	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Auto 75 Criteria A1	0,61
Auto 75 Criteria B1	0,61
Transaktionskostnader, tSEK	38
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,01
Högst 3 % får tas ut i årlig fast avgift för förvaltningen av de underliggande fonder som fonden placerar medel i. Eventuellt förekommande prestationsbaserad förvaltningsavgift i de underliggande fonderna får på respektive mätperiod högst uppgå till 30 % av övervakningen i förhållande till respektive fonds jämförelsenorm (index eller motsvarande)	

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,1
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	26,8
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått \*

Total risk % - A1 SEK	11,1	Aktiv avkastning % - A1 SEK	-0,4
Total risk % - B1 SEK	11,1	Aktiv avkastning % - B1 SEK	-0,4
Total risk i index % - A1 SEK	11,1	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk i index % - B1 SEK	11,1	Informationskvot - B1 SEK	Negativ
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (30%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (7,5%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (30%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (7,5%), SHB Sweden All Bond Tradable Index (12,5%), OMRX Treasury Bill Index (9,375%), OMRX Mortgage Bond 1-3 y Index (3,125%).	Sharpekvot - A1 SEK	0,3
		Sharpekvot - B1 SEK	0,3
		Sharpekvot i index - A1 SEK	0,3
		Sharpekvot i index - B1 SEK	0,3

\* Riskskiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Fondandelar	1 910 870	99,9	1 406 087	100,0
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>1 910 870</b>	<b>99,9</b>	<b>1 406 087</b>	<b>100,0</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	10 787	0,6	2 837	0,2
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	515	0,0	388	0,0
Övriga tillgångar	11 057	0,6	6 871	0,5
<b>Summa tillgångar</b>	<b>1 933 231</b>	<b>101,1</b>	<b>1 416 183</b>	<b>100,7</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	913	0,0	711	0,1
Övriga skulder	20 487	1,1	8 682	0,6
<b>Summa skulder</b>	<b>21 401</b>	<b>1,1</b>	<b>9 393</b>	<b>0,7</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>1 911 830</b>	<b>100,0</b>	<b>1 406 790</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

Handelsbanken Auto 75 Criteria, forts.

**Fondens innehav av finansiella instrument****Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 19,8**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
BÖRSHANDLADE AKTIEFONDER			
XACT Norden Högutdelande (UCITS ETF)	1 097 105	141 026	7,4
		<b>141 026</b>	<b>7,4</b>
BÖRSHANDLADE RÄNTEFONDER			
XACT Obligation (UCITS ETF)	2 488 574	237 693	12,4
		<b>237 693</b>	<b>12,4</b>
<b>Fondandelar</b>		<b>378 719</b>	<b>19,8</b>

**Övriga finansiella instrument 80,1**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
AKTIEFONDER			
SHB Global Index Criteria (A1 SEK)	1 236 327	574 734	30,1
SHB Global Småbolag Index Criteria (A1 SEK)	870 155	143 796	7,5
SHB Norden Index Criteria (A1 SEK)	3 258 268	576 607	30,2
		<b>1 295 138</b>	<b>67,7</b>
RÄNTEFONDER			
SHB Kortränta SEK (A1 SEK)	2 227 038	237 013	12,4
		<b>237 013</b>	<b>12,4</b>
<b>Fondandelar</b>		<b>1 532 151</b>	<b>80,1</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>1 910 870</b>	<b>99,9</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		960	0,1
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>1 911 830</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 2 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.



# Handelsbanken Auto 100 Criteria

## Placeringsinriktning

Fonden är en regelstyrd blandfond med en målsättning att erbjuda en förutbestämd allokering. Fonden är passivt förvaltd. Fonden placerar 100% i aktiefonder (målviktt). Fondens avkastning bestäms av hur de aktiefonder som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Aktiedelen ska i sin tur fördelas med 50% global aktiemarknad och 50% nordisk aktiemarknad. Målvikterna rebalanseras kvartalsvis såvida inte innehaven avviker från målvikten med mer än +/- 2,5 procentenheter. I sådant fall rebalanseras viktarna direkt. Fonden placerar till minst 90% i fonder inom Handelsbanken. De aktieindex som är styrande för aktieexponeringen är Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (40%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (40%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (10%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (10%). Fonden är en specialfond, vilket för denna fond innebär att den avviker från en värdepappersfond genom att den kan ha stora innehav i enskilda fonder. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 12,8% under första halvåret 2023\*.

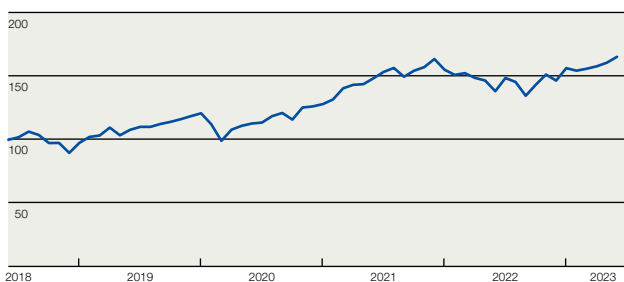
De största innehaven i fonden är Handelsbanken Norden Index Criteria och Handelsbanken Global Index Criteria.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Auto 100 Criteria A1 - SEK	164,78	146,07	163,02	125,75	118,14	89,23	-	-	-	-
Auto 100 Criteria B1 - SEK	101,25	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Fondens totala nettovärde, mnSEK	269	196	297	184	152	22	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, tusental	1 358	954	846	399	189	20	-	-	-	-
Auto 100 Criteria A1 - SEK	1 358	954	846	399	189	20	-	-	-	-
Auto 100 Criteria B1 - SEK	0	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	8 243	6 528	5 190	3 169	1 598	219	-	-	-	-
Auto 100 Criteria A1 - SEK	8 241	6 528	5 190	3 169	1 598	219	-	-	-	-
Auto 100 Criteria B1 - SEK	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Auto 100 Criteria A1 - SEK	12,8	-10,4	29,6	6,4	32,4	-10,8	-	-	-	-
Auto 100 Criteria B1 - SEK	12,9	-10,4	29,6	6,4	32,4	-	-	-	-	-
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Auto 100 Criteria A1 - SEK	13,0	-10,2	30,5	7,1	-	-	-	-	-	-
Auto 100 Criteria B1 - SEK	13,0	-10,2	30,5	7,1	-	-	-	-	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Auto 100 Criteria A1 - SEK	0,1	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-
Auto 100 Criteria B1 - SEK	0,2	0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-

nedgångar i andelsvärdet. Värdet på fonden kan därmed variera kraftigt över tid. Fonden har möjlighet att placera koncentrerat både avseende region och sektor. Detta innebär att risken i fonden kan vara högre än en investering i en diversifierad global fond som fördelar sina investeringar över flera regioner eller sektorer. Då fondens investeringar sker i utländska värdepapper denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. Fonden får placera i derivat och kan göra det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall mycket begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort), inval av underliggande fonder baserat på hållbarhetsanalys, samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning i underliggande fonder.

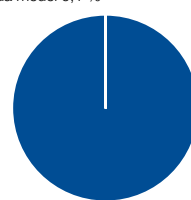
## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

## Marknadsexponering\*

Räntebärande inkl. likvida medel 0,1 %



Aktier 100,0 %

\* Fondens placeringsfördelning inom marknaderna per 2023-06-30, i förhållande till fondens totala tillgångar vid detta datum.

Handelsbanken Auto 100 Criteria, forts.

Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %									
Auto 100 Criteria A1 - SEK	5,6	7,8	17,5	18,7	-	-	-	-	-
Auto 100 Criteria B1 - SEK	5,6	7,8	17,5	18,7	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	5,9	8,2	18,2	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %									
Auto 100 Criteria A1 - SEK	10,6	-	-	-	-	-	-	-	-
Auto 100 Criteria B1 - SEK	10,6	-	-	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK	3,79	-	-	-	-	-	-	-	-

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (40%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (40%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (10%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (10%).  
 T o m 2020-05-10: SIX SRI Nordic Index NI (40%), SHB Nordic Smart Beta Index (10%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (40%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (10%).  
 T o m 2020-06-16: SIX SRI Nordic Index NI (40%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (10%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (40%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (10%).  
 T o m 2021-05-20: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (40%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (10%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (40%), Solactive ISS ESG Screened Developed Markets Small Cap Index (10%).  
 T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (40%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (10%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (40%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (10%).  
 T o m 2021-08-31: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (40%), Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (10%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (40%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (10%).

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevantt branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se Information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Auto 100 Criteria A1	0,60
Auto 100 Criteria B1	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Auto 100 Criteria A1	0,60
Auto 100 Criteria B1	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Auto 100 Criteria A1	0,62
Auto 100 Criteria B1	0,62
Transaktionskostnader, tSEK	12
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00
Högst 3 % får tas ut i årlig fast avgift för förvaltningen av de underliggande fonder som fonden placerar medel i. Eventuellt förekommande prestationsbaserad förvaltningsavgift i de underliggande fonderna får på respektive mätperiod högst uppgå till 30 % av överavkastningen i förhållande till respektive fonds jämförelsenorm (index eller motsvarande)	

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,0
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	13,0
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått \*

Total risk % - A1 SEK	14,3	Aktiv avkastning % - A1 SEK	-0,4
Total risk % - B1 SEK	14,3	Aktiv avkastning % - B1 SEK	-0,3
Total risk i index % - A1 SEK	14,3	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk i index % - B1 SEK	14,3	Informationskvot - B1 SEK	Negativ
Jämförelseindex		Sharpekvot - A1 SEK	0,3
Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (40%),		Sharpekvot - B1 SEK	0,3
Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (40%),		Sharpekvot i index - A1 SEK	0,4
Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) (10%),		Sharpekvot i index - B1 SEK	0,4
Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Developed Markets Small Cap Index (10%).			

\* Riskfaktorn är baserad på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Fondandelar	1 358 119	100,0	953 603	100,0
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>1 358 119</b>	<b>100,0</b>	<b>953 603</b>	<b>100,0</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	3 668	0,3	854	0,1
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	440	0,0	318	0,0
Övriga tillgångar	3 120	0,2	1 278	0,1
<b>Summa tillgångar</b>	<b>1 365 348</b>	<b>100,5</b>	<b>956 053</b>	<b>100,3</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	646	0,0	481	0,1
Övriga skulder	6 553	0,5	1 966	0,2
<b>Summa skulder</b>	<b>7 199</b>	<b>0,5</b>	<b>2 447</b>	<b>0,3</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>1 358 149</b>	<b>100,0</b>	<b>953 606</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 10,0**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>FONDANDELAR</b>			
<b>BÖRSHANDLADE AKTIEFONDER</b>			
XACT Norden Högutdelande (UCITS ETF)	1 052 549	135 299	10,0
<b>Fondandelar</b>		<b>135 299</b>	<b>10,0</b>

**Övriga finansiella instrument 90,0**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>FONDANDELAR</b>			
<b>AKTIEFONDER</b>			
SHB Global Index Criteria (A1 SEK)	1 164 440	541 316	39,9
SHB Global Småbolag Index Criteria (A1 SEK)	824 203	136 203	10,0
SHB Norden Index Criteria (A1 SEK)	3 081 368	545 302	40,2
		<b>1 222 820</b>	<b>90,0</b>
<b>Fondandelar</b>		<b>1 222 820</b>	<b>90,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>1 358 119</b>	<b>100,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		30	0,0
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>1 358 149</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

## Uppgifter om fondens värdepapperslån

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

## Uppgifter om avkastning och kostnad:

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 1 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.





# Handelsbanken Pension 40

## Placeringsinriktning

Fonden är en regelstyrd blandfond och är främst anpassad för pensionssparande för dig som är född på 40-talet. Målet är att ge en god avkastning med successivt minskad risk fram till tidpunkten för pensionering. Fondens avkastning bestäms av hur de aktie- och räntefonder som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Fonden placerar främst i nordiska och globala aktiefonder samt svenska räntefonder. Fondens aktieexponering ska vara ca 25% och fondens ränteeponering ca 75% av fondens värde. Aktieexponeringen ska utgöras av 50% exponering mot index som representerar de globala aktiemarknaderna och 50% exponering mot index som representerar de nordiska aktiemarknaderna. Ränteeponeringen utgörs av exponering mot index som representerar räntemarknaden i Sverige. De aktieindex som är styrande för aktieexponeringen är Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (12,50%) och Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (12,5%). De ränteindex som är styrande för ränteeponeringen är OMRXTBILL (37,5%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (26,25%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (11,25%). Fonden beaktar internationella normer och riktlinjer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning och tillämpar en exkluderingsstrategi på bolag (såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i) verksamma inom områdena/branscherna alkohol, tobak, cannabis, kommersiell spelverksamhet, vapen och krigsmateriel, pornografi och fossila bränslen. Fonden kan dock investera i bolag som bedöms ställa om sin verksamhet från fossil energiproduktion till förnybar. Detta gäller såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i. För fondens placeringar i indexderivat kommer fonden i första hand att placera i hållbarhetsanpassade instrument. I avsaknad av sådana instrument kommer fonden att placera i indexderivat och indexprodukter där det kan komma att ingå bolag som inte tillåts enligt ovan exkluderingskriterier. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 3,8% under första halvåret 2023\*. Portföljen utgörs av fonder och börshandlade fonder, så kallade ETF:er. De tre största innehaven i fonden var Handelsbanken Institutionell Kortränta, Handelsbanken Långränta och Handelsbanken Norden Index Criteria. Fonden hade under året en större andel räntefonder än aktiefonder.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en blandfond som är riskklassificerad med 2 av 7, dvs. en låg

riskklass. Det betyder att fonden har låg risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Risken i fonden beror på fondens fördelning mellan tillgångsslagen aktier och räntor samt fondens återstående placeringshorisont. En investering i aktier och aktiefonder kan vara förenade med hög risk och kan variera kraftigt över tid. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är förenad med ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindningstid har en högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindningstid. Räntebindningstiden på innehaven i fonden kan variera väsentligt över tid. Fonden har möjlighet att placera koncentrerat både avseende region och sektor. Detta innebär att risken i fonden kan vara högre än en investering i en diversifierad global fond som fördelar sina investeringar över flera regioner eller sektorer. Då fondens investeringar sker i utländska värdepapper denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden får som en del i sin placeringsinriktning investera i derivat i syfte att öka avkastningen i fonden. Investeringar i derivat kan innebära att fonden har en ökad känslighet för marknadsförändringar.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort), inval av underliggande fonder baserat på hållbarhetsanalys, samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning i underliggande fonder.

## Handel med derivatinstrument m.m

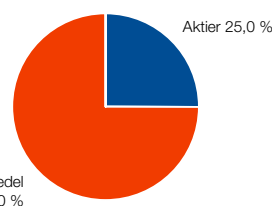
Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

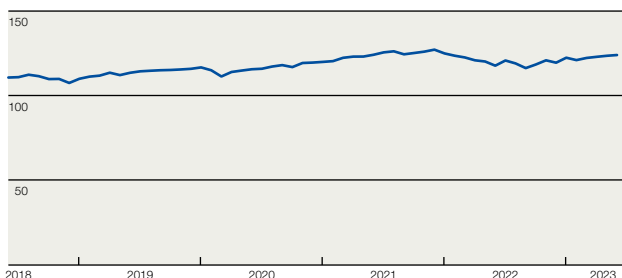
## Information

Fondens avkastningshistorik före startdatum härleds från fusionen (19 oktober 2018) då handelsbanken Funds Pension 40 (Luxemburg) lades samman med Handelsbanken Pension 40 (Sverige).

## Marknadsexponering\*



## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

\* Fondens placeringsfördelning inom marknaderna per 2023-06-30, i förhållande till fondens totala tillgångar vid detta datum.

Handelsbanken Pension 40, forts.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Pension 40 A1 - SEK	118,68	114,35	121,72	114,41	110,89	102,89	-	-	-	-
Pension 40 A12 - SEK	153,45	147,48	156,20	146,09	140,88	130,07	-	-	-	-
Pension 40 A13 - SEK	147,95	142,44	151,39	142,09	137,51	127,41	-	-	-	-
Fondens totala nettoförände, mnSEK	-62	-139	-66	-95	-92	-13	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	1 569	1 570	1 815	1 767	1 801	1 755	-	-	-	-
Pension 40 A1 - SEK	67	66	76	61	58	40	-	-	-	-
Pension 40 A12 - SEK	575	558	612	535	494	403	-	-	-	-
Pension 40 A13 - SEK	928	947	1 127	1 171	1 250	1 312	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	10 579	11 005	11 984	12 434	13 116	13 786	-	-	-	-
Pension 40 A1 - SEK	562	575	620	531	522	390	-	-	-	-
Pension 40 A12 - SEK	3 745	3 782	3 917	3 660	3 505	3 098	-	-	-	-
Pension 40 A13 - SEK	6 273	6 648	7 447	8 243	9 088	10 298	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Pension 40 A1 - SEK	3,8	-6,1	6,4	3,2	7,8	-0,5	3,4	4,1	0,6	8,0
Pension 40 A12 - SEK	4,0	-5,6	6,9	3,7	8,3	0,1	4,0	4,7	1,2	8,5
Pension 40 A13 - SEK	3,9	-5,9	6,5	3,3	7,9	-0,3	3,6	4,3	0,8	8,1
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Pension 40 A1 - SEK	3,8	-5,7	6,7	2,8	7,9	-0,4	2,9	3,9	2,3	9,6
Pension 40 A12 - SEK	3,8	-5,7	6,7	2,8	7,9	-0,4	2,9	3,9	2,3	9,6
Pension 40 A13 - SEK	3,8	-5,7	6,7	2,8	7,9	-0,4	2,9	3,9	2,3	9,6
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Pension 40 A1 - SEK	0,6	0,5	0,4	0,3	0,3	0,4	0,4	0,5	0,6	0,6
Pension 40 A12 - SEK	0,6	0,5	0,4	0,3	0,3	0,4	0,4	0,5	0,6	0,6
Pension 40 A13 - SEK	0,6	0,5	0,4	0,3	0,3	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Pension 40 A1 - SEK	-0,1	0,0	4,8	5,4	3,6	1,5	3,8	2,3	4,2	7,8
Pension 40 A12 - SEK	0,4	0,5	5,3	6,0	4,1	2,0	4,3	2,9	4,8	8,4
Pension 40 A13 - SEK	0,1	0,1	4,9	5,6	3,7	1,6	4,0	2,5	4,4	8,0
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	0,3	0,3	4,7	5,3	3,7	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Pension 40 A1 - SEK	2,3	2,0	4,0	3,6	3,0	3,1	4,7	-	-	-
Pension 40 A12 - SEK	2,8	2,6	4,6	4,1	3,6	3,6	5,3	-	-	-
Pension 40 A13 - SEK	2,4	2,2	4,2	3,7	3,2	3,3	4,9	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	2,4	2,1	3,9	3,4	3,3	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %										
Pension 40 A1 - SEK	3,5	3,4	-	-	-	-	-	-	-	-
Pension 40 A12 - SEK	4,0	3,9	-	-	-	-	-	-	-	-
Pension 40 A13 - SEK	3,7	3,5	-	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	3,8	3,6	-	-	-	-	-	-	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta - historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (12,50%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (12,50%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (26,25%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (11,25%), OMRXTBILL (37,50%).

T o m 2019-04-30: VINX Benchmark Cap SEK\_NI (12,50%), MSCI All Country World Index Net (12,50%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (26,25%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (11,25%), OMRXTBILL (37,50%).

T o m 2020-06-16: SIX SPI Nordic Index NI (12,50%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (12,50%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (26,25%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (11,25%), OMRXTBILL (37,50%).

T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index SIX SPI Nordic Index NI (12,5%) och Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (12,5%) och styrande för räntexponeringen är HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (26,25%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (11,25%), OMRXTBILL (37,50%).

T o m 2021-08-31: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (12,50%) och Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (12,50%).

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Pension 40 A1	0,50
Pension 40 A12	0,00
Pension 40 A13	0,35
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Pension 40 A1	0,50
Pension 40 A12	0,00
Pension 40 A13	0,35
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Pension 40 A1	0,51
Pension 40 A12	0,01
Pension 40 A13	0,36
Transaktionskostnader, tSEK	0
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00
Högst 3 % får tas ut i årlig fast avgift för förvaltningen av de underliggande fonder som fonden placerar medel i. Eventuellt förekommande prestationsbaserad förvaltningsavgift i de underliggande fonderna får på respektive mätperiod högst uppgå till 30 % av överavkastningen i förhållande till respektive fonds jämförelsenorm (index eller motsvarande)	

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,1
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	8,8
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk % - A1 SEK	5,0	Aktiv avkastning % - A1 SEK	-0,4
Total risk % - A12 SEK	5,1	Aktiv avkastning % - A12 SEK	0,1
Total risk % - A13 SEK	5,0	Aktiv avkastning % - A13 SEK	-0,2
Total risk i index % - A1 SEK	5,0	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk i index % - A12 SEK	5,0	Informationskvot - A12 SEK	0,2
Total risk i index % - A13 SEK	5,0	Informationskvot - A13 SEK	Negativ
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG	Sharpekvot - A1 SEK	-0,2
	Screened Paris Aligned	Sharpekvot - A12 SEK	-0,1
	Nordic Index (12,50%),	Sharpekvot - A13 SEK	-0,1
	Solactive ISS ESG	Sharpekvot i index - A1 SEK	-0,1
	Screened Paris Aligned	Sharpekvot i index - A12 SEK	-0,1
	Global Markets Index	Sharpekvot i index - A13 SEK	-0,1
	(12,50%),		
	HMNI Swe All	Sharpekvot i index - A13 SEK	-0,1
	Government Dur Const		
	6Y (HMSD6) (26,25%),		
	HMNI Swe All Mortgage		
	Dur Const 2.5Y		
	(HMSMD25) (11,25%),		
	OMRXTBILL (37,50%).		

\* Riskiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

Handelsbanken Pension 40, forts.

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Fondandelar	1 554 725	99,1	1 563 687	99,6
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>1 554 725</b>	<b>99,1</b>	<b>1 563 687</b>	<b>99,6</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	16 179	1,0	13 435	0,9
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	396	0,0	405	0,0
Övriga tillgångar	2 301	0,1	116	0,0
<b>Summa tillgångar</b>	<b>1 573 601</b>	<b>100,3</b>	<b>1 577 644</b>	<b>100,5</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	291	0,0	315	0,0
Övriga skulder	3 930	0,3	6 886	0,4
<b>Summa skulder</b>	<b>4 221</b>	<b>0,3</b>	<b>7 201</b>	<b>0,5</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>1 569 381</b>	<b>100,0</b>	<b>1 570 442</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument			11	0,0
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument			12	0,0

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 12,9**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
<b>BÖRSHANDLADE RÄNTEFONDER</b>			
XACT Obligation (UCITS ETF)	2 124 000	202 872	12,9
		<b>202 872</b>	<b>12,9</b>
Fondandelar		202 872	12,9

**Övriga finansiella instrument 86,1**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
<b>AKTIEFONDER</b>			
SHB Global Index Criteria (A1 SEK)	357 379	166 136	10,6
SHB Global Småbolag Index Criteria (A1 SEK)	195 016	32 227	2,1
SHB Norden Index Criteria (A1 SEK)	1 119 511	198 117	12,6
		<b>396 480</b>	<b>25,3</b>
<b>RÄNTEFONDER</b>			
SHB Institutionell Kortränta (A1 SEK)	2 986 576	305 240	19,4
SHB Kortränta (A1 SEK)	1 048 704	154 436	9,8
SHB Kortränta SEK (A1 SEK)	1 049 602	111 704	7,1
SHB Långränta (A1 SEK)	2 160 723	226 910	14,5
SHB Ränteavkastning (A1 SEK)	88 091	157 083	10,0
		<b>955 374</b>	<b>60,9</b>
Fondandelar		1 351 854	86,1
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>1 554 725</b>	<b>99,1</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		14 655	0,9
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>1 569 381</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 1 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

-Merrill Lynch International



# Handelsbanken Pension 50

## Placeringsinriktning

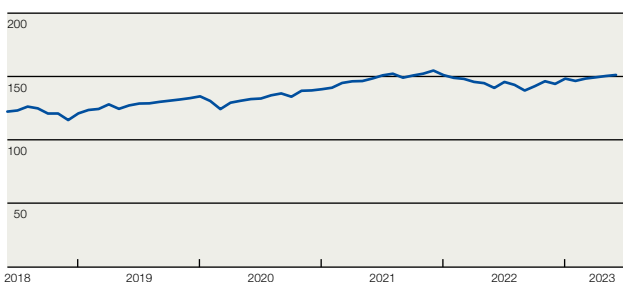
Fonden är en regelstyrd blandfond och är främst anpassad för pensionssparande för dig som är född på 50-talet. Målet är att ge en god avkastning med successivt minskad risk fram till tidpunkten för pensionering. Fondens avkastning bestäms av hur de aktie- och räntefonder som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Fonden placerar främst i nordiska och globala aktiefonder samt räntefonder. Vi minskar andelen aktier och ökar andelen räntebärande värdepapper successivt fram till pensionsåldern. Från och med det år den förstfödde i kategorin (personer födda på 50-talet) fyllt 56 år ska aktieexponeringen successivt viktas ned med 3,75 procentenheter per år till dess att aktieexponeringen är ca 25%. Aktieexponeringen ska utgöras av ca 50% exponering mot index som representerar de globala aktiemarknaderna och ca 50% exponering mot index som representerar de nordiska aktiemarknaderna. Ränteeponeringen utgörs av exponering mot index som representerar räntemarknaden i Sverige. De aktieindex som är styrande för aktieexponeringen är Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (16,250%) och Solactive ISS ESG Screened Global Markets (16,250%). De ränteindex som är styrande för ränteeponeringen är OMRXTBILL (33,750%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (23,625%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (10,125%). Fonden beaktar internationella normer och riktlinjer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning och tillämpar en exkluderingsstrategi på bolag (såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i) verksamma inom områdena/branscherna alkohol, tobak, cannabis, kommersiell spelverksamhet, vapen och krigsmateriel, pornografi och fossila bränslen. Fonden kan dock investera i bolag som bedöms ställa om sin verksamhet från fossil energiproduktion till förnybar. Detta gäller såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i. För fondens placeringar i indexderivat kommer fonden i första hand att placera i hållbarhetsanpassade instrument. I avsaknad av sådana instrument kommer fonden att placera i indexderivat och indexprodukter där det kan komma att ingå bolag som inte tillåts enligt ovan exkluderingskriterier. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 4,9% under första halvåret 2023\*. Portföljen utgörs av fonder och börshandlade fonder, så kallade ETF:er. De tre största innehaven i fonden var Handelsbanken Institutionell Kortrränta, Handelsbanken Långränta och Handelsbanken Norden Index Criteria. Fonden hade under året en större andel räntefonder än aktiefonder.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en blandfond som är riskklassificerad med 3 av 7, dvs. en medellåg riskklass. Det betyder att fonden har medellåg risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Risken i fonden beror på fondens fördelning mellan tillgångsslagen aktier och räntor samt fondens återstående placeringshorisont. En investering i aktier och aktiefonder kan vara förenade med hög risk och kan variera kraftigt över tid. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är förenad med ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindningstid har en högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindningstid. Räntebindningstiden på innehaven i fonden kan variera väsentligt över tid. Fonden har möjlighet att placera koncentrerat både avseende region och sektor. Detta innebär att risken i fonden kan vara högre än en investering i en diversifierad global fond som fördelar sina investeringar över flera regioner eller sektorer. Då fondens investeringar sker i utländska värdepapper denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden får som en del i sin placeringsinriktning investera i derivat i syfte att öka avkastningen i fonden. Investeringar i derivat kan innebära att fonden har en ökad känslighet för marknadsförändringar.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort), inval av underliggande fonder baserat på hållbarhetsanalys, samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning i underliggande fonder.

## Handel med derivatinstrument m.m

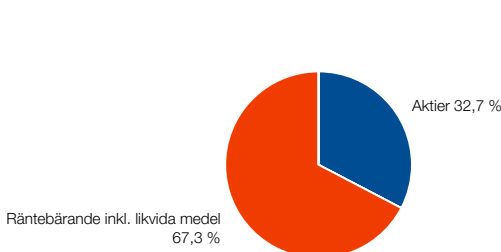
Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

## Information

Fondens avkastningshistorik före startdatum härleds från fusionen (19 oktober 2018) då handelsbanken Funds Pension 50 (Luxemburg) lades samman med Handelsbanken Pension 50 (Sverige).

## Marknadsexponering\*



\* Fondens placeringsfördelning inom marknaderna per 2023-06-30, i förhållande till fondens totala tillgångar vid detta datum.

Handelsbanken Pension 50, forts.

**Fondfakta - historik**

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Pension 50 A1 - SEK	136,54	130,17	139,66	125,55	120,05	104,49	-	-	-	-
Pension 50 A12 - SEK	213,34	202,88	216,59	193,73	184,33	159,63	-	-	-	-
Pension 50 A13 - SEK	205,71	195,97	209,95	188,44	179,93	156,37	-	-	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	-227	-303	-108	-13	418	103	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	14 374	13 908	15 217	13 750	13 135	11 020	-	-	-	-
Pension 50 A1 - SEK	469	432	434	303	248	144	-	-	-	-
Pension 50 A12 - SEK	3 613	3 455	3 687	3 232	2 975	2 282	-	-	-	-
Pension 50 A13 - SEK	10 292	10 021	11 096	10 214	9 912	8 594	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	70 404	71 481	72 985	73 302	73 296	70 632	-	-	-	-
Pension 50 A1 - SEK	3 437	3 315	3 111	2 417	2 068	1 383	-	-	-	-
Pension 50 A12 - SEK	16 937	17 031	17 023	16 684	16 141	14 296	-	-	-	-
Pension 50 A13 - SEK	50 029	51 135	52 851	54 202	55 087	54 953	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Pension 50 A1 - SEK	4,9	-6,8	11,2	4,6	14,9	-1,5	6,7	7,2	3,1	14,5
Pension 50 A12 - SEK	5,2	-6,3	11,8	5,1	15,5	-1,0	7,3	7,7	3,7	15,1
Pension 50 A13 - SEK	5,0	-6,7	11,4	4,7	15,1	-1,4	6,9	7,4	3,3	14,7
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Pension 50 A1 - SEK	4,8	-6,4	11,3	4,4	14,8	-1,1	6,7	7,5	5,5	16,7
Pension 50 A12 - SEK	4,8	-6,4	11,3	4,4	14,8	-1,1	6,7	7,5	5,5	16,7
Pension 50 A13 - SEK	4,8	-6,4	11,3	4,4	14,8	-1,1	6,7	7,5	5,5	16,7
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Pension 50 A1 - SEK	0,5	0,5	0,4	0,4	0,5	0,5	0,7	0,8	0,6	0,7
Pension 50 A12 - SEK	0,5	0,5	0,4	0,4	0,5	0,5	0,7	0,8	0,6	0,7
Pension 50 A13 - SEK	0,5	0,5	0,4	0,4	0,5	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Pension 50 A1 - SEK	0,9	1,8	7,9	9,6	6,4	2,5	7,0	5,1	8,7	15,4
Pension 50 A12 - SEK	1,4	2,3	8,4	10,2	6,9	3,1	7,5	5,7	9,2	16,0
Pension 50 A13 - SEK	1,1	2,0	8,0	9,8	6,5	2,7	7,2	5,3	8,8	15,6
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	1,2	2,1	7,8	9,5	6,5	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Pension 50 A1 - SEK	4,3	4,2	7,0	6,2	5,9	5,9	9,4	-	-	-
Pension 50 A12 - SEK	4,8	4,7	7,6	6,8	6,5	6,4	10,0	-	-	-
Pension 50 A13 - SEK	4,5	4,3	7,2	6,4	6,1	6,0	9,7	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	4,4	4,3	7,1	6,3	6,6	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %										
Pension 50 A1 - SEK	6,7	6,8	-	-	-	-	-	-	-	-
Pension 50 A12 - SEK	7,2	7,3	-	-	-	-	-	-	-	-
Pension 50 A13 - SEK	6,8	7,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	7,2	7,3	-	-	-	-	-	-	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta - historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (16,25%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (16,25%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (23,625%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (10,125%), OMRXTBILL (33,75%)  
 T o m 2019-04-30: VINX Benchmark Cap SEK\_NI (25,63%), MSCI All Country World Index Net (25,63%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (17,06%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (7,31%), OMRXTBILL (24,38%)  
 T o m 2020-06-16: SIX SRI Nordic Index NI (25,63%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (25,63%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (17,06%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (7,31%), OMRXTBILL (24,38%)  
 T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index SIX SRI Nordic Index NI (21,875%) och Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (21,875%) och styrande för räntexponeringen är HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (19,6875%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (8,4375%), OMRXTBILL (28,125%)  
 T o m 2021-08-31: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (21,875%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (21,875%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (19,6875%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (8,4375%), OMRXTBILL (28,125%)  
 T o m 2022-12-31: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (18,125%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (18,125%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (22,313%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (9,563%), OMRXTBILL (31,875%).

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsdrag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagad. För närmare beskrivning av andelsklasserna beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

**Fondfakta - kostnader**

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Pension 50 A1	0,50
Pension 50 A12	0,00
Pension 50 A13	0,35
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Pension 50 A1	0,50
Pension 50 A12	0,00
Pension 50 A13	0,35
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Pension 50 A1	0,51
Pension 50 A12	0,01
Pension 50 A13	0,36
Transaktionskostnader, tSEK	0
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00
Högst 3 % får tas ut i årlig fast avgift för förvaltningen av de underliggande fonder som fonden placerar medel i. Eventuellt förekommande prestationsbaserad förvaltningsavgift i de underliggande fonderna får på respektive mätperiod högst uppgå till 30 % av överavkastningen i förhållande till respektive fonds jämförelsenorm (index eller motsvarande)	

**Fondfakta - övriga nyckeltal**

Omsättningshastighet, ggr	0,2
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	5,9
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

**Risk- och avkastningsmått\***

Total risk % - A1 SEK	6,5	Aktiv avkastning % - A1 SEK	-0,3
Total risk % - A12 SEK	6,5	Aktiv avkastning % - A12 SEK	0,2
Total risk % - A13 SEK	6,5	Aktiv avkastning % - A13 SEK	-0,2
Total risk i index % - A1 SEK	6,4	Informationskvot - A1 SEK	Negativ
Total risk i index % - A12 SEK	6,4	Informationskvot - A12 SEK	0,4
Total risk i index % - A13 SEK	6,4	Informationskvot - A13 SEK	Negativ
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (16,25%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (16,25%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (23,625%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (10,125%), OMRXTBILL (33,75%).	Sharpekvot - A1 SEK	0,0
		Sharpekvot - A12 SEK	0,1
		Sharpekvot - A13 SEK	0,1
		Sharpekvot i index - A1 SEK	0,1
		Sharpekvot i index - A12 SEK	0,1
		Sharpekvot i index - A13 SEK	0,1

\* Riskfiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt ätagandemetoden

Handelsbanken Pension 50, forts.

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Fondandelar	14 334 129	99,7	13 734 859	98,8
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>14 334 129</b>	<b>99,7</b>	<b>13 734 859</b>	<b>98,8</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	65 714	0,5	244 145	1,8
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	4 191	0,0	4 136	0,0
Övriga tillgångar	180	0,0	239	0,0
<b>Summa tillgångar</b>	<b>14 404 215</b>	<b>100,2</b>	<b>13 983 380</b>	<b>100,5</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplypna kostnader och förutbetalda intäkter	3 161	0,0	3 198	0,0
Övriga skulder	26 933	0,2	72 528	0,5
<b>Summa skulder</b>	<b>30 095</b>	<b>0,2</b>	<b>75 725</b>	<b>0,5</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>14 374 120</b>	<b>100,0</b>	<b>13 907 655</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 6,9**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FONDANDELAR</b>			
<b>BÖRSHANDLADE RÄNTEFONDER</b>			
XACT Obligation (UCITS ETF)	10 360 000	989 524	6,9
		<b>989 524</b>	<b>6,9</b>
<b>Fondandelar</b>		<b>989 524</b>	<b>6,9</b>

**Övriga finansiella instrument 92,8**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FONDANDELAR</b>			
<b>AKTIEFONDER</b>			
SHB Global Index Criteria (A1 SEK)	5 069 001	2 356 438	16,4
SHB Norden Index Criteria (A1 SEK)	13 364 071	2 365 006	16,5
		<b>4 721 444</b>	<b>32,8</b>
<b>RÄNTEFONDER</b>			
SHB Institutionell Kortränta (A1 SEK)	27 360 443	2 796 346	19,5
SHB Kortränta (A1 SEK)	6 731 663	991 330	6,9
SHB Kortränta SEK (A1 SEK)	9 357 789	995 904	6,9
SHB Långränta (A1 SEK)	26 841 411	2 818 774	19,6
SHB Ränteavkastning (A1 SEK)	572 457	1 020 807	7,1
		<b>8 623 161</b>	<b>60,0</b>
<b>Fondandelar</b>		<b>13 344 605</b>	<b>92,8</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>14 334 129</b>	<b>99,7</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		39 991	0,3
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>14 374 120</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.



# Handelsbanken Pension 60

## Placeringsinriktning

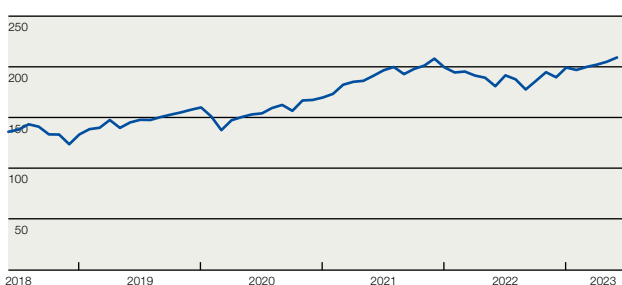
Fonden är en regelstyrd blandfond och är främst anpassad för pensionssparande för dig som är född på 60-talet. Målet är att ge en god avkastning med successivt minskad risk fram till tidpunkten för pensionering. Fondens avkastning bestäms av hur de aktie- och räntefonder som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Fonden placerar i nordiska och globala aktiefonder samt räntefonder. Vi minskar andelen aktier och ökar andelen räntebärande värdepapper successivt fram till pensionsåldern. Från och med det år den förstfödde i kategorin (personer födda på 60-talet) fyllt 56 år ska aktieexponeringen successivt viktas ned med 3,75 procentenheter per år till dess att aktieexponeringen är ca 25%. Aktieexponeringen ska utgöras av ca 50% exponering mot index som representerar de globala aktiemarknaderna och ca 50% exponering mot index som representerar de nordiska aktiemarknaderna. Ränteeponeringen utgörs av exponering mot index som representerar räntemarknaden i Sverige. De aktieindex som är styrande för aktieexponeringen är Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (35%) och Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets (35%). De ränteindex som är styrande för ränteeponeringen är HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (10,5%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (4,5%) och OMRXTBILL (15%). Fonden beaktar internationella normer och riktlinjer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning och tillämpar en exkluderingsstrategi på bolag (såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i) verksamma inom områdena/branscherna alkohol, tobak, cannabis, kommersiell spelverksamhet, vapen och krigsmateriel, pornografi och fossila bränslen. Fonden kan dock investera i bolag som bedöms ställa om sin verksamhet från fossil energiproduktion till förnybar. Detta gäller såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i. För fondens placeringar i indexderivat kommer fonden i första hand att placera i hållbarhetsanpassade instrument. I avsaknad av sådana instrument kommer fonden att placera i indexderivat och indexprodukter där det kan komma att ingå bolag som inte tillåts enligt ovan exkluderingskriterier. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 10,3% under första halvåret 2023\*. Portföljen utgörs av fonder och börshandlade fonder, så kallade ETF:er. De tre största innehaven i fonden var Handelsbanken Global Index Criteria, Handelsbanken Norden Index Criteria och Handelsbanken Institutionell Kortränta. Fonden hade under året en större andel aktiefonder än räntefonder.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en blandfond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Risken i fonden beror på fondens fördelning mellan tillgångsslagen aktier och räntor samt fondens återstående placeringshorisont. En investering i aktier och aktiefonder kan vara förenade med hög risk och kan variera kraftigt över tid. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är förenad med ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindningstid har en högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindningstid. Räntebindningstiden på innehaven i fonden kan variera väsentligt över tid. Fonden har möjlighet att placera koncentrerat både avseende region och sektor. Detta innebär att risken i fonden kan vara högre än en investering i en diversifierad global fond som fördelar sina investeringar över flera regioner eller sektorer. Då fondens investeringar sker i utländska värdepapper denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden får som en del i sin placeringsinriktning investera i derivat i syfte att öka avkastningen i fonden. Investeringar i derivat kan innebära att fonden har en ökad känslighet för marknadsförändringar.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort), inval av underliggande fonder baserat på hållbarhetsanalys, samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning i underliggande fonder.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

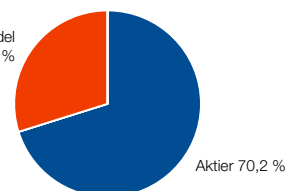
- |   |      |
|---|------|
| • Högsta hävstång under räkenskapsåret        | 0.0% |
| • Lägsta hävstång under räkenskapsåret        | 0.0% |
| • Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret | 0.0% |

## Information

Fondens avkastningshistorik före startdatum härleds från fusionen (19 oktober 2018) då handelsbanken Funds Pension 60 (Luxemburg) lades samman med Handelsbanken Pension 60 (Sverige).

## Marknadsexponering\*

Räntebärande inkl. likvida medel  
29,9 %



\* Fondens placeringsfördelning inom marknaderna per 2023-06-30, i förhållande till fondens totala tillgångar vid detta datum.

Handelsbanken Pension 60, forts.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Pension 60 A1 - SEK	178,99	162,31	178,00	143,23	134,98	105,94	-	-	-	-
Pension 60 A12 - SEK	326,59	295,43	322,37	258,11	242,02	189,00	-	-	-	-
Pension 60 A13 - SEK	314,92	285,37	312,48	251,07	236,25	185,14	-	-	-	-
Fondens totala nettoföföde, mnSEK	1 442	2 103	2 317	1 630	2 057	399	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	38 723	33 713	34 601	25 731	22 538	15 891	-	-	-	-
Pension 60 A1 - SEK	1 218	923	854	453	321	157	-	-	-	-
Pension 60 A12 - SEK	9 229	8 113	8 421	6 277	5 451	3 611	-	-	-	-
Pension 60 A13 - SEK	28 276	24 676	25 326	19 001	16 766	12 123	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	124 850	119 621	111 968	103 162	95 870	86 071	-	-	-	-
Pension 60 A1 - SEK	6 803	5 688	4 798	3 160	2 377	1 486	-	-	-	-
Pension 60 A12 - SEK	28 260	27 463	26 122	24 321	22 521	19 106	-	-	-	-
Pension 60 A13 - SEK	89 788	86 470	81 048	75 681	70 972	65 479	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Pension 60 A1 - SEK	10,3	-8,8	24,3	6,1	27,4	-3,2	10,5	10,2	5,3	19,4
Pension 60 A12 - SEK	10,5	-8,4	24,9	6,6	28,1	-2,7	11,1	10,8	5,9	20,1
Pension 60 A13 - SEK	10,4	-8,7	24,5	6,3	27,6	-3,0	10,8	10,4	5,5	19,6
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Pension 60 A1 - SEK	9,8	-8,7	23,6	7,4	27,0	-2,3	11,6	11,5	8,4	22,1
Pension 60 A12 - SEK	9,8	-8,7	23,6	7,4	27,0	-2,3	11,6	11,5	8,4	22,1
Pension 60 A13 - SEK	9,8	-8,7	23,6	7,4	27,0	-2,3	11,6	11,5	8,4	22,1
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Pension 60 A1 - SEK	0,6	0,6	0,7	0,8	0,9	0,8	1,2	1,2	0,9	1,0
Pension 60 A12 - SEK	0,6	0,6	0,7	0,8	0,9	0,8	1,2	1,2	0,9	1,0
Pension 60 A13 - SEK	0,6	0,6	0,7	0,8	0,9	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Pension 60 A1 - SEK	4,6	6,5	14,8	16,3	11,1	3,4	10,4	7,7	12,1	21,5
Pension 60 A12 - SEK	5,1	7,0	15,4	16,9	11,6	4,0	11,0	8,3	12,7	22,2
Pension 60 A13 - SEK	4,7	6,6	15,0	16,5	11,2	3,6	10,6	7,9	12,3	21,8
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	4,4	6,3	15,2	16,8	11,4	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Pension 60 A1 - SEK	9,0	8,2	12,4	9,8	9,6	8,2	13,6	-	-	-
Pension 60 A12 - SEK	9,5	8,8	13,0	10,4	10,2	8,8	14,2	-	-	-
Pension 60 A13 - SEK	9,1	8,4	12,6	10,0	9,8	8,4	13,9	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	9,0	8,5	13,0	10,7	10,8	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %										
Pension 60 A1 - SEK	11,0	10,9	-	-	-	-	-	-	-	-
Pension 60 A12 - SEK	11,6	11,5	-	-	-	-	-	-	-	-
Pension 60 A13 - SEK	11,2	11,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	12,0	11,9	-	-	-	-	-	-	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta - historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (35,00 %), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (35,00 %), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (10,50 %), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (4,50%), OMRXTBILL (15,00 %).

T o m 2019-04-30: VINX Benchmark Cap SEK\_NI (44,38%), MSCI All Country World Index Net (44,38%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (3,94%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (1,69%), OMRXTBILL (5,63%)

T o m 2020-06-16: SIX SRI Nordic Index NI (44,38%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (44,38%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (3,94%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (1,69%), OMRXTBILL (5,63%)

T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index SIX SRI Nordic Index NI (40,625%) och Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (40,625%) och styrande för räntexponeringen är HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (6,5625%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (2,8125%), OMRXTBILL (9,375%)

T o m 2021-08-31: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (40,625%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (40,625%), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (6,5625%), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (2,8125%), OMRXTBILL (9,375%)

T o m 2022-12-31: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (36,875 %), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (36,875 %), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (9,188 %), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (3,938 %), OMRXTBILL (13,125 %).

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagad.

För närmare beskrivning av andelsklasserna beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Pension 60 A1	0,50
Pension 60 A12	0,00
Pension 60 A13	0,35
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Pension 60 A1	0,50
Pension 60 A12	0,00
Pension 60 A13	0,35
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Pension 60 A1	0,51
Pension 60 A12	0,01
Pension 60 A13	0,36
Transaktionskostnader, tSEK	0
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00
Högst 3 % får tas ut i årlig fast avgift för förvaltningen av de underliggande fonder som fonden placerar medel i. Eventuellt förekommande prestationsbaserad förvaltningsavgift i de underliggande fonderna får på respektive mätperiod högst uppgå till 30 % av överavkastningen i förhållande till respektive fonds jämförelsenorm (index eller motsvarande)	

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,2
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	15,1
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk % - A1 SEK	11,2	Aktiv avkastning % - A1 SEK	0,2
Total risk % - A12 SEK	11,2	Aktiv avkastning % - A12 SEK	0,7
Total risk % - A13 SEK	11,2	Aktiv avkastning % - A13 SEK	0,4
Total risk i index % - A1 SEK	11,2	Informationskvot - A1 SEK	0,3
Total risk i index % - A12 SEK	11,2	Informationskvot - A12 SEK	1,2
Total risk i index % - A13 SEK	11,2	Informationskvot - A13 SEK	0,6
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (35,00 %), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (35,00 %), HMNI Swe All Government Dur Const 6Y (HMSD6) (10,50 %), HMNI Swe All Mortgage Dur Const 2.5Y (HMSMD25) (4,50%), OMRXTBILL (15,00 %).	Sharpekvot - A1 SEK	0,3
		Sharpekvot - A12 SEK	0,4
		Sharpekvot - A13 SEK	0,4
		Sharpekvot i index - A1 SEK	0,3
		Sharpekvot i index - A12 SEK	0,3
		Sharpekvot i index - A13 SEK	0,3

\* Riskiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt ätagandemetoden



Handelsbanken Pension 60, forts.

**Balansräkning, tSEK**

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Fondandelar	38 679 996	99,9	33 519 815	99,4
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>38 679 996</b>	<b>99,9</b>	<b>33 519 815</b>	<b>99,4</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	31 219	0,1	263 970	0,8
Förtutbetalda kostnader och upplupna intäkter	11 633	0,0	10 182	0,0
Övriga tillgångar	22 300	0,1	1 630	0,0
<b>Summa tillgångar</b>	<b>38 745 147</b>	<b>100,1</b>	<b>33 795 597</b>	<b>100,2</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förtutbetalda intäkter	8 544	0,0	7 776	0,0
Övriga skulder	13 318	0,0	75 252	0,2
<b>Summa skulder</b>	<b>21 862</b>	<b>0,1</b>	<b>83 028</b>	<b>0,2</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>38 723 284</b>	<b>100,0</b>	<b>33 712 570</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	8 271	0,0	1 577	0,0
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	10 990	0,0	1 694	0,0

**Fondens innehav av finansiella instrument****Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 13,1**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FONDANDELAR</b>			
<b>BÖRSHANDLADE AKTIEFONDER</b>			
XACT Norden (UCITS ETF)	15 550 000	3 616 752	9,3
XACT Norden Högutdelande (UCITS ETF)	3 930 000	505 177	1,3
		<b>4 121 928</b>	<b>10,6</b>
<b>BÖRSHANDLADE RÄNTEFONDER</b>			
XACT Obligation (UCITS ETF)	10 020 000	957 049	2,5
		<b>957 049</b>	<b>2,5</b>
Fondandelar		5 078 978	13,1

**Övriga finansiella instrument 86,8**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FONDANDELAR</b>			
<b>AKTIEFONDER</b>			
SHB Emerging Market Index (A1 SEK)	4 483 209	846 799	2,2
SHB Europa Index Criteria (A1 SEK)	5 108 080	953 043	2,5
SHB Global Index Criteria (A1 SEK)	16 587 120	7 710 893	19,9
SHB Global Småbolag Index Criteria (A1 SEK)	5 926 934	979 448	2,5
SHB Norden Index Criteria (A1 SEK)	43 539 039	7 704 994	19,9
SHB Sverige Index Criteria (A1 SEK)	4 257 501	1 763 835	4,6
SHB USA Index Criteria (A1 SEK)	4 199 793	3 145 648	8,1
		<b>23 104 661</b>	<b>59,7</b>
<b>RÄNTEFONDER</b>			
SHB Institutionell Kortränta (A1 SEK)	55 887 034	5 711 876	14,8
SHB Kortränta (A1 SEK)	5 991	882	0,0
SHB Kortränta SEK (A1 SEK)	2 807	299	0,0
SHB Långränta (A1 SEK)	43 744 043	4 593 819	11,9
SHB Ränteavkastning (A1 SEK)	106 259	189 481	0,5
		<b>10 496 357</b>	<b>27,1</b>
Fondandelar		<b>33 601 018</b>	<b>86,8</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>38 679 996</b>	<b>99,9</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		43 288	0,1
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>38 723 284</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån****Volym utlånade värdepapper, tSEK 8 271****Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar 0,0****De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:**

Franska staten	757
Barclays	552
Relx	552
BP	552
Lloyds Banking Group	552
Shell	552
Hsbc Holdings	552
Unilever	552
Sse	552
AstraZeneca	552

**De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:**

Svenska Handelsbanken 10 990

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:**

Aktier	10 233
Obligationer och andra räntebärande instrument	757
	<b>10 990</b>

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	-
En till tre månader	-
Tre månader till ett år	-
Mer än ett år	757
Obestämmd löptid	10 233
	<b>10 990</b>

**Motparternas hemvist, tSEK**

Sverige	10 990
	<b>10 990</b>

**Säkerheternas valuta, tSEK**

CHF	152
EUR	1 459
GBP	6 767
JPY	399
SEK	552
USD	1 662
	<b>10 990</b>

**Avveckling och clearing, tSEK**

Tredje part	10 990
	<b>10 990</b>

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämmd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 16 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

-J.P. Morgan Securities  
-Svenska Handelsbanken

# Handelsbanken Pension 70

## Placeringsinriktning

Fonden är en regelstyrd blandfond och är främst anpassad för pensionsparande för dig som är född på 70-talet. Målet är att ge en god avkastning med successivt minskad risk fram till tidpunkten för pensionering. Fondens avkastning bestäms av hur de aktie- och räntefonder som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Fonden placerar främst i nordiska och globala aktiefonder samt räntefonder. Vi minskar andelen aktier och ökar andelen räntebärande värdepapper successivt fram till pensionsåldern. Från och med det år den förstfödde i kategorin (personer födda på 70-talet) fyllt 56 år ska aktieexponeringen successivt viktas ned med 3,75 procentenheter per år till dess att aktieexponeringen är ca 25%. Aktieexponeringen ska utgöras av ca 50% exponering mot index som representerar de globala aktiemarknaderna och ca 50% exponering mot index som representerar de nordiska aktiemarknaderna. Ränteeponeringen utgörs av exponering mot index som representerar räntemarknaden i Sverige. De aktieindex som är styrande för aktieexponeringen är Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (50%) och Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets (50%). Nedtrappningen av aktieexponeringen till fördel för ränteeponering har ännu inte påbörjats i fonden. Fonden beaktar internationella normer och riktlinjer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning och tillämpar en exkluderingsstrategi på bolag (såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i) verksamma inom områdena/branscherna alkohol, tobak, cannabis, kommersiell spelverksamhet, vapen och krigsmateriel, pornografi och fossila bränslen. Fonden kan dock investera i bolag som bedöms ställa om sin verksamhet från fossil energiproduktion till förnybar. Detta gäller såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i. För fondens placeringar i indexderivat kommer fonden i första hand att placera i hållbarhetsanpassade instrument. I avsaknad av sådana instrument kommer fonden att placera i indexderivat och indexprodukter där det kan komma att ingå bolag som inte tillåts enligt ovan exkluderingskriterier. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

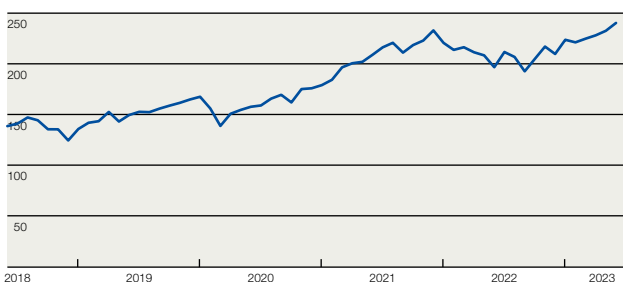
## Portföljen

Fonden steg med 14,6% under första halvåret 2023\*.

Portföljen utgörs av fonder och börshandlade fonder, så kallade ETF:er. De tre största innehaven i fonden var Handelsbanken Norden Index Criteria, Handelsbanken Global Index Criteria och XACT Norden. Fonden hade under året endast innehav i aktiefonder.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en blandfond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Risken i fonden beror på fondens fördelning mellan tillgångsslagen aktier och räntor samt fondens återstående placeringshorisont. En investering i aktier och aktiefonder kan vara förenade med hög risk och kan variera kraftigt över tid. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är förenad med ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindningstid har en högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindningstid. Räntebindningstiden på innehaven i fonden kan variera väsentligt över tid. Fonden har möjlighet att placera koncentrerat både avseende region och sektor. Detta innebär att risken i fonden kan vara högre än en investering i en diversifierad global fond som fördelar sina investeringar över flera regioner eller sektorer. Då fondens investeringar sker i utländska värdepapper denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden får som en del i sin placeringsinriktning investera i derivat i syfte att öka avkastningen i fonden. Investeringar i derivat kan innebära att fonden har en ökad känslighet för marknadsförändringar.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort), inval av underliggande fonder baserat på hållbarhetsanalys, samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning i underliggande fonder.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

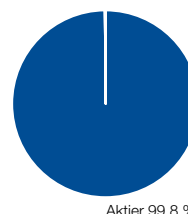
- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

## Information

Fondens avkastningshistorik före startdatum härleds från fusionen (19 oktober 2018) då handelsbanken Funds Pension 70 (Luxemburg) lades samman med Handelsbanken Pension 70 (Sverige).

## Marknadsexponering\*

Räntebärande inkl. likvida medel 0,1 %



Aktier 99,8 %

\* Fondens placeringsfördelning inom marknaderna per 2023-06-30, i förhållande till fondens totala tillgångar vid detta datum.

Handelsbanken Pension 70, forts.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Pension 70 A1 - SEK	204,36	178,40	198,12	149,67	140,29	106,03	-	-	-	-
Pension 70 A12 - SEK	375,48	326,97	361,30	271,58	253,29	190,48	-	-	-	-
Pension 70 A13 - SEK	362,08	315,84	350,23	264,18	247,25	186,59	-	-	-	-
Fondens totala nettovärde, mnSEK	1 248	2 181	2 617	1 747	1 865	346	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	33 579	28 121	28 748	19 434	16 382	10 812	-	-	-	-
Pension 70 A1 - SEK	1 057	768	698	353	234	112	-	-	-	-
Pension 70 A12 - SEK	9 951	8 584	8 850	5 863	4 781	2 860	-	-	-	-
Pension 70 A13 - SEK	22 571	18 769	19 200	13 218	11 367	7 840	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	94 010	89 982	82 839	73 981	66 516	58 095	-	-	-	-
Pension 70 A1 - SEK	5 172	4 303	3 524	2 357	1 666	1 063	-	-	-	-
Pension 70 A12 - SEK	26 501	26 253	24 494	21 590	18 877	15 015	-	-	-	-
Pension 70 A13 - SEK	62 338	59 427	54 821	50 034	45 973	42 017	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Pension 70 A1 - SEK	14,6	-10,0	32,4	6,7	32,3	-3,9	11,5	10,9	5,2	19,7
Pension 70 A12 - SEK	14,8	-9,5	33,0	7,2	33,0	-3,4	12,1	11,5	5,7	20,4
Pension 70 A13 - SEK	14,6	-9,8	32,6	6,8	32,5	-3,7	11,7	11,1	5,4	19,9
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Pension 70 A1 - SEK	14,0	-10,4	31,5	8,7	32,1	-2,7	12,6	11,9	8,4	22,1
Pension 70 A12 - SEK	14,0	-10,4	31,5	8,7	32,1	-2,7	12,6	11,9	8,4	22,1
Pension 70 A13 - SEK	14,0	-10,4	31,5	8,7	32,1	-2,7	12,6	11,9	8,4	22,1
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Pension 70 A1 - SEK	0,9	0,9	0,8	1,0	1,0	0,9	1,1	1,2	0,9	0,9
Pension 70 A12 - SEK	0,9	0,9	0,8	1,0	1,0	0,9	1,1	1,2	0,9	0,9
Pension 70 A13 - SEK	0,9	0,9	0,8	1,0	1,0	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Pension 70 A1 - SEK	7,2	9,2	18,8	18,8	12,8	3,5	11,2	8,0	12,2	21,6
Pension 70 A12 - SEK	7,8	9,7	19,4	19,4	13,4	4,1	11,8	8,6	12,8	22,2
Pension 70 A13 - SEK	7,4	9,3	19,0	19,0	13,0	3,7	11,4	8,2	12,4	21,8
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	6,5	8,5	19,6	19,8	13,4	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Pension 70 A1 - SEK	11,6	10,1	14,9	10,9	10,6	8,4	14,0	-	-	-
Pension 70 A12 - SEK	12,2	10,7	15,5	11,5	11,2	9,0	14,6	-	-	-
Pension 70 A13 - SEK	11,8	10,3	15,1	11,1	10,8	8,6	14,2	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	11,7	10,5	15,7	12,0	11,9	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %										
Pension 70 A1 - SEK	12,6	12,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Pension 70 A12 - SEK	13,2	12,6	-	-	-	-	-	-	-	-
Pension 70 A13 - SEK	12,8	12,2	-	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	13,6	13,0	-	-	-	-	-	-	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta – historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (50%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets (50%)

T o m 2019-04-30: VINX Benchmark Cap SEK, NI (50%), MSCI All Country World Index Net (50%)

T o m 2020-06-16: SIX SRI Nordic Index NI (50%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (50%)

T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index SIX SRI Nordic Index NI (50%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (50%)

T o m 2021-08-31: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (50%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (50%).

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringssinriktning, tillgångsslag, marknads- och i de fall det är relevanta branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se Information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fonddrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Pension 70 A1	0,50
Pension 70 A12	0,00
Pension 70 A13	0,35
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Pension 70 A1	0,50
Pension 70 A12	0,00
Pension 70 A13	0,35
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Pension 70 A1	0,51
Pension 70 A12	0,01
Pension 70 A13	0,36
Transaktionskostnader, tSEK	0
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00
Högst 3 % får tas ut i årlig fast avgift för förvaltningen av de underliggande fonder som fonden placerar medel i. Eventuellt förekommande prestationsbaserad förvaltningsavgift i de underliggande fonderna får på respektive mätperiod högst uppgå till 30 % av övervaknings- eller driftskostnader i förhållande till respektive fonds jämförelsenorm (index eller motsvarande)	

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,1
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	16,6
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk % - A1 SEK	14,4	Aktiv avkastning % - A1 SEK	0,7
Total risk % - A12 SEK	14,4	Aktiv avkastning % - A12 SEK	1,2
Total risk % - A13 SEK	14,4	Aktiv avkastning % - A13 SEK	0,9
Total risk i index % - A1 SEK	14,6	Informationskvot - A1 SEK	0,7
Total risk i index % - A12 SEK	14,6	Informationskvot - A12 SEK	1,3
Total risk i index % - A13 SEK	14,6	Informationskvot - A13 SEK	0,9
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG	Sharpekvot - A1 SEK	0,5
	Screened Paris Aligned Nordic Index (50%),	Sharpekvot - A12 SEK	0,5
	Solactive ISS ESG	Sharpekvot - A13 SEK	0,5
	Screened Paris	Sharpekvot i index - A1 SEK	0,4
	Aligned Global Markets	Sharpekvot i index - A12 SEK	0,4
	(50%)	Sharpekvot i index - A13 SEK	0,4

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fonddrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Fondandelar	33 530 509	99,9	28 077 442	99,8
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>33 530 509</b>	<b>99,9</b>	<b>28 077 442</b>	<b>99,8</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	40 268	0,1	50 511	0,2
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	9 677	0,0	8 203	0,0
Övriga tillgångar	28 680	0,1	743	0,0
<b>Summa tillgångar</b>	<b>33 609 135</b>	<b>100,1</b>	<b>28 136 898</b>	<b>100,1</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	6 823	0,0	5 945	0,0
Övriga skulder	23 685	0,1	10 228	0,0
<b>Summa skulder</b>	<b>30 508</b>	<b>0,1</b>	<b>16 173</b>	<b>0,1</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>33 578 627</b>	<b>100,0</b>	<b>28 120 726</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

Handelsbanken Pension 70, forts.

**Fondens innehav av finansiella instrument****Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 19,7**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
BÖRSHANDLADE AKTIEFONDER			
XACT Norden (UCITS ETF)	23 940 000	5 568 169	16,6
XACT Norden Högutdelande (UCITS ETF)	8 020 000	1 030 921	3,1
		<b>6 599 090</b>	<b>19,7</b>
Fondandelar		6 599 090	19,7

**Övriga finansiella instrument 80,2**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
AKTIEFONDER			
SHB Emerging Market Index (A1 SEK)	7 757 269	1 465 212	4,4
SHB Europa Index Criteria (A1 SEK)	8 938 690	1 667 742	5,0
SHB Global Index Criteria (A1 SEK)	14 372 823	6 681 527	19,9
SHB Global Småbolag Index Criteria (A1 SEK)	9 138 315	1 510 140	4,5
SHB Norden Index Criteria (A1 SEK)	37 588 075	6 651 867	19,8
SHB Sverige Index Criteria (A1 SEK)	8 445 141	3 498 728	10,4
SHB USA Index Criteria (A1 SEK)	7 284 643	5 456 203	16,2
		<b>26 931 419</b>	<b>80,2</b>
Fondandelar		26 931 419	80,2
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>33 530 509</b>	<b>99,9</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		48 118	0,1
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>33 578 627</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

Vi godtar statsobligationer och statskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 24 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

-Citigroup Global Markets  
-Merrill Lynch International  
-Svenska Handelsbanken



# Handelsbanken Pension 80

## Placeringsinriktning

Fonden är en regelstyrd blandfond och är främst anpassad för pensionsparande för dig som är född på 80-talet. Målet är att ge en god avkastning med successivt minskad risk fram till tidpunkten för pensionering. Fondens avkastning bestäms av hur de aktie- och räntefonder som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Fonden placerar främst i nordiska och globala aktiefonder samt räntefonder. Vi minskar andelen aktier och ökar andelen räntebärande värdepapper successivt fram till pensionsåldern. Från och med det år den förstfödde i kategorin (personer födda på 80-talet) fyllt 56 år ska aktieexponeringen successivt viktas ned med 3,75 procentenheter per år till dess att aktieexponeringen är ca 25%. Aktieexponeringen ska utgöras av ca 50% exponering mot index som representerar de globala aktiemarknaderna och ca 50% exponering mot index som representerar de nordiska aktiemarknaderna. Ränteeponeringen utgörs av exponering mot index som representerar räntemarknaden i Sverige. De aktieindex som är styrande för aktieexponeringen är Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (50%) och Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets (50%). Nedtrappningen av aktieexponeringen till fördel för ränteeponering har ännu inte påbörjats i fonden. Fonden beaktar internationella normer och riktlinjer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning och tillämpar en exkluderingsstrategi på bolag (såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i) verksamma inom områdena/branscherna alkohol, tobak, cannabis, kommersiell spelverksamhet, vapen och krigsmateriel, pornografi och fossila bränslen. Fonden kan dock investera i bolag som bedöms ställa om sin verksamhet från fossil energiproduktion till förnybar. Detta gäller såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i. För fondens placeringar i indexderivat kommer fonden i första hand att placera i hållbarhetsanpassade instrument. I avsaknad av sådana instrument kommer fonden att placera i indexderivat och indexprodukter där det kan komma att ingå bolag som inte tillåts enligt ovan exkluderingskriterier. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

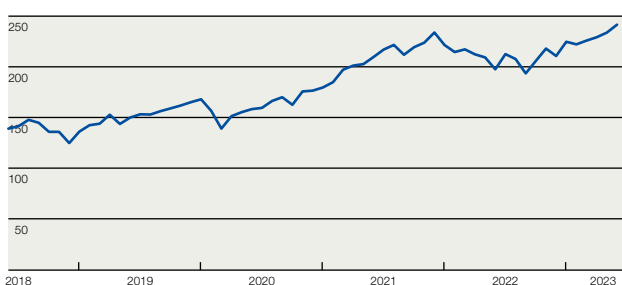
## Portföljen

Fonden steg med 14,6% under första halvåret 2023\*.

Portföljen utgörs av fonder och börshandlade fonder, så kallade ETF:er. De tre största innehaven i fonden var Handelsbanken Norden Index Criteria, Handelsbanken Global Index Criteria och XACT Norden. Fonden hade under året endast innehav i aktiefonder.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en blandfond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Risken i fonden beror på fondens fördelning mellan tillgångsslagen aktier och räntor samt fondens återstående placeringshorisont. En investering i aktier och aktiefonder kan vara förenade med hög risk och kan variera kraftigt över tid. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är förenad med ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindningstid har en högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindningstid. Räntebindningstiden på innehaven i fonden kan variera väsentligt över tid. Fonden har möjlighet att placera koncentrerat både avseende region och sektor. Detta innebär att risken i fonden kan vara högre än en investering i en diversifierad global fond som fördelar sina investeringar över flera regioner eller sektorer. Då fondens investeringar sker i utländska värdepapper denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden får som en del i sin placeringsinriktning investera i derivat i syfte att öka avkastningen i fonden. Investeringar i derivat kan innebära att fonden har en ökad känslighet för marknadsförändringar.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort), inval av underliggande fonder baserat på hållbarhetsanalys, samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning i underliggande fonder.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

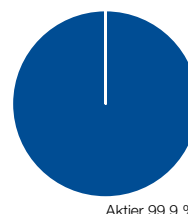
- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

## Information

Fondens avkastningshistorik före startdatum härleds från fusionen (19 oktober 2018) då handelsbanken Funds Pension 80 (Luxemburg) lades samman med Handelsbanken Pension 80 (Sverige).

## Marknadsexponering\*

Räntebärande inkl. likvida medel 0,1 %



Aktier 99,9 %

\* Fondens placeringsfördelning inom marknaderna per 2023-06-30, i förhållande till fondens totala tillgångar vid detta datum.

Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Pension 80 A1 - SEK	205,36	179,16	198,81	150,17	140,53	106,32	-	-	-	-
Pension 80 A12 - SEK	377,37	328,40	362,61	272,52	253,75	191,03	-	-	-	-
Pension 80 A13 - SEK	363,91	317,25	351,52	265,12	247,72	187,14	-	-	-	-
Fondens totala nettovärde, mnSEK	570	964	1 005	770	896	177	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	12 017	9 942	9 939	6 639	5 414	3 348	-	-	-	-
Pension 80 A1 - SEK	702	514	450	222	145	66	-	-	-	-
Pension 80 A12 - SEK	4 164	3 541	3 657	2 505	2 074	1 207	-	-	-	-
Pension 80 A13 - SEK	7 152	5 886	5 832	3 912	3 195	2 075	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	34 103	32 207	28 939	25 424	22 103	18 028	-	-	-	-
Pension 80 A1 - SEK	3 416	2 870	2 263	1 478	1 034	624	-	-	-	-
Pension 80 A12 - SEK	11 034	10 784	10 086	9 191	8 173	6 319	-	-	-	-
Pension 80 A13 - SEK	19 653	18 554	16 590	14 756	12 896	11 085	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Pension 80 A1 - SEK	14,6	-9,9	32,4	6,9	32,2	-3,6	11,5	10,9	5,2	19,7
Pension 80 A12 - SEK	14,9	-9,4	33,1	7,4	32,8	-3,1	12,1	11,5	5,7	20,3
Pension 80 A13 - SEK	14,7	-9,7	32,6	7,0	32,4	-3,4	11,7	11,1	5,4	19,8
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Pension 80 A1 - SEK	14,0	-10,4	31,5	8,7	32,1	-2,7	12,6	11,9	8,4	22,1
Pension 80 A12 - SEK	14,0	-10,4	31,5	8,7	32,1	-2,7	12,6	11,9	8,4	22,1
Pension 80 A13 - SEK	14,0	-10,4	31,5	8,7	32,1	-2,7	12,6	11,9	8,4	22,1
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Pension 80 A1 - SEK	0,9	0,9	0,8	0,8	0,8	0,8	1,1	1,2	0,9	0,9
Pension 80 A12 - SEK	0,9	0,9	0,8	0,8	0,8	0,8	1,1	1,2	0,9	0,9
Pension 80 A13 - SEK	0,9	0,9	0,8	0,8	0,8	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Pension 80 A1 - SEK	7,3	9,2	18,9	18,8	12,9	3,7	11,2	8,0	12,2	21,5
Pension 80 A12 - SEK	7,9	9,8	19,5	19,4	13,5	4,2	11,8	8,6	12,8	22,2
Pension 80 A13 - SEK	7,5	9,4	19,1	19,0	13,1	3,9	11,4	8,2	12,4	21,8
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	6,5	8,5	19,6	19,8	13,4	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Pension 80 A1 - SEK	11,6	10,2	15,0	11,0	10,6	8,5	13,9	-	-	-
Pension 80 A12 - SEK	12,2	10,8	15,6	11,6	11,2	9,0	14,6	-	-	-
Pension 80 A13 - SEK	11,8	10,4	15,2	11,2	10,8	8,6	14,2	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	11,7	10,5	15,7	12,0	11,9	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %										
Pension 80 A1 - SEK	12,7	12,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Pension 80 A12 - SEK	13,2	12,6	-	-	-	-	-	-	-	-
Pension 80 A13 - SEK	12,8	12,2	-	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	13,6	13,0	-	-	-	-	-	-	-	-

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta - historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.  
 Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (50%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (50%).  
 T o m 2019-04-30: VINX Benchmark Cap SEK, NI (50%), MSCI All Country World Index Net (50%)  
 T o m 2020-06-16: SIX SRI Nordic Index NI (50%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (50%)  
 T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index SIX SRI Nordic Index NI (50%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (50%)  
 T o m 2021-08-31: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (50%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (50%).

Fondens jämförelseindex utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.  
 För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget.  
 För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Pension 80 A1	0,50
Pension 80 A12	0,00
Pension 80 A13	0,35
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Pension 80 A1	0,50
Pension 80 A12	0,00
Pension 80 A13	0,35
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Pension 80 A1	0,51
Pension 80 A12	0,01
Pension 80 A13	0,36
Transaktionskostnader, tSEK	0
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00
Högst 3 % får tas ut i årlig fast avgift för förvaltningen av de underliggande fonder som fonden placerar medel i. Eventuellt förekommande prestationsbaserad förvaltningsavgift i de underliggande fonderna får på respektive mätperiod högst uppgå till 30 % av övervakningen i förhållande till respektive fonds jämförelseindex (index eller motsvarande)	

Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,1
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	25,2
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

Risk- och avkastningsmått\*

Total risk % - A1 SEK	14,4	Aktiv avkastning % - A1 SEK	0,8
Total risk % - A12 SEK	14,4	Aktiv avkastning % - A12 SEK	1,3
Total risk % - A13 SEK	14,4	Aktiv avkastning % - A13 SEK	0,9
Total risk i index % - A1 SEK	14,6	Informationskvot - A1 SEK	0,8
Total risk i index % - A12 SEK	14,6	Informationskvot - A12 SEK	1,4
Total risk i index % - A13 SEK	14,6	Informationskvot - A13 SEK	1,0
Jämförelseindex		Sharpekvot - A1 SEK	0,5
Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (50%)		Sharpekvot - A12 SEK	0,5
Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (50%)		Sharpekvot - A13 SEK	0,5
		Sharpekvot i index - A1 SEK	0,4
		Sharpekvot i index - A12 SEK	0,4
		Sharpekvot i index - A13 SEK	0,4

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.  
 De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Fondandelar	11 998 684	99,8	9 921 321	99,8
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>11 998 684</b>	<b>99,8</b>	<b>9 921 321</b>	<b>99,8</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	9 334	0,1	21 850	0,2
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	3 374	0,0	2 884	0,0
Övriga tillgångar	22 712	0,2	8 691	0,1
<b>Summa tillgångar</b>	<b>12 034 104</b>	<b>100,1</b>	<b>9 954 745</b>	<b>100,1</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	2 304	0,0	1 977	0,0
Övriga skulder	14 483	0,1	11 030	0,1
<b>Summa skulder</b>	<b>16 787</b>	<b>0,1</b>	<b>13 007</b>	<b>0,1</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>12 017 317</b>	<b>100,0</b>	<b>9 941 738</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	446	0,0	32	0,0
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	475	0,0	34	0,0

Handelsbanken Pension 80, forts.

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 21,3**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>FONDANDELAR</b>			
BÖRSHANDLADE AKTIEFONDER			
XACT Norden (UCITS ETF)	9 480 000	2 204 939	18,3
XACT Norden Högutdelande (UCITS ETF)	2 750 000	353 495	2,9
		<b>2 558 434</b>	<b>21,3</b>
Fondandelar		2 558 434	21,3

**Övriga finansiella instrument 78,6**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>FONDANDELAR</b>			
AKTIEFONDER			
SHB Emerging Market Index (A1 SEK)	2 805 359	529 883	4,4
SHB Europa Index Criteria (A1 SEK)	3 218 207	600 439	5,0
SHB Global Index Criteria (A1 SEK)	5 125 163	2 382 546	19,8
SHB Global Småbolag Index Criteria (A1 SEK)	3 220 961	532 276	4,4
SHB Norden Index Criteria (A1 SEK)	13 449 431	2 380 112	19,8
SHB Sverige Index Criteria (A1 SEK)	2 527 758	1 047 222	8,7
SHB USA Index Criteria (A1 SEK)	2 627 195	1 967 771	16,4
		<b>9 440 249</b>	<b>78,6</b>
Fondandelar		9 440 249	78,6
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>11 998 684</b>	<b>99,8</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		18 633	0,2
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>12 017 317</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

## Uppgifter om fondens värdepapperslån

Volym utlånade värdepapper, tSEK 446

Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar 0,0

## De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:

Franska staten	260
Brittiska staten	81
Amerikanska staten	78
Tyska staten	20
Nederländska staten	16
Finska staten	15
Österrikiska staten	6

## De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:

Merrill Lynch International 475

## Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:

Obligationer och andra räntebärande instrument 475

475

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

## Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	-
En till tre månader	-
Tre månader till ett år	84
Mer än ett år	391
Obestämd löptid	-
	<b>475</b>

## Motparternas hemvist, tSEK

Storbritannien 475

475

## Säkerheternas valuta, tSEK

EUR 316

GBP 81

USD 78

475

## Avveckling och clearing, tSEK

Tredje part 475

475

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

## Uppgifter om avkastning och kostnad:

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 7 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

## Motparter för värdepappersutlåning under året:

-Merrill Lynch International

-Svenska Handelsbanken



# Handelsbanken Pension 90

## Placeringsinriktning

Fonden är en regelstyrd blandfond och är främst anpassad för pensionsparande för dig som är född på 90-talet. Målet är att ge en god avkastning med successivt minskad risk fram till tidpunkten för pensionering. Fondens avkastning bestäms av hur de aktie- och räntefonder som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Fonden placerar främst i nordiska och globala aktiefonder samt räntefonder. Vi minskar andelen aktier och ökar andelen räntebärande värdepapper successivt fram till pensionsåldern. Från och med det år den förstfödde i kategorin (personer födda på 90-talet) fyllt 56 år ska aktieexponeringen successivt viktas ned med 3,75 procentenheter per år till dess att aktieexponeringen är ca 25%. Aktieexponeringen ska utgöras av ca 50% exponering mot index som representerar de globala aktiemarknaderna och ca 50% exponering mot index som representerar de nordiska aktiemarknaderna. Ränteeponeringen utgörs av exponering mot index som representerar räntemarknaden i Sverige. De aktieindex som är styrande för aktieexponeringen är Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (50%) och Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets (50%). Nedtrappningen av aktieexponeringen till fördel för ränteeponering har ännu inte påbörjats i fonden. Fonden beaktar internationella normer och riktlinjer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning och tillämpar en exkluderingsstrategi på bolag (såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i) verksamma inom områdena/branscherna alkohol, tobak, cannabis, kommersiell spelverksamhet, vapen och krigsmateriel, pornografi och fossila bränslen. Fonden kan dock investera i bolag som bedöms ställa om sin verksamhet från fossil energiproduktion till förnybar. Detta gäller såväl direkta innehav som innehav i fonder som fonden investerar i. För fondens placeringar i indexderivat kommer fonden i första hand att placera i hållbarhetsanpassade instrument. I avsaknad av sådana instrument kommer fonden att placera i indexderivat och indexprodukter där det kan komma att ingå bolag som inte tillåts enligt ovan exkluderingskriterier. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

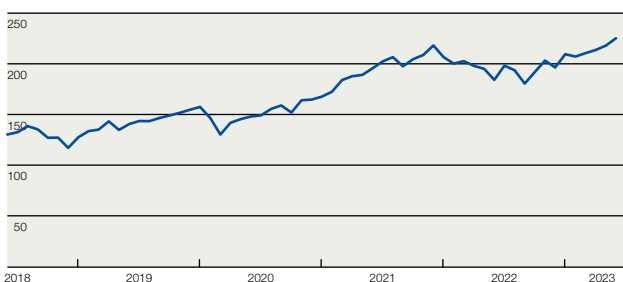
## Portföljen

Fonden steg med 14,6% under första halvåret 2023\*.

Portföljen utgörs av fonder och börshandlade fonder, så kallade ETF:er. De tre största innehaven i fonden var Handelsbanken Norden Index Criteria, Handelsbanken Global Index Criteria och XACT Norden. Fonden hade under året endast innehav i aktiefonder.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en blandfond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Risken i fonden beror på fondens fördelning mellan tillgångsslagen aktier och räntor samt fondens återstående placeringshorisont. En investering i aktier och aktiefonder kan vara förenade med hög risk och kan variera kraftigt över tid. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är förenad med ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindningstid har en högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindningstid. Räntebindningstiden på innehaven i fonden kan variera väsentligt över tid. Fonden har möjlighet att placera koncentrerat både avseende region och sektor. Detta innebär att risken i fonden kan vara högre än en investering i en diversifierad global fond som fördelar sina investeringar över flera regioner eller sektorer. Då fondens investeringar sker i utländska värdepapper denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden får som en del i sin placeringsinriktning investera i derivat i syfte att öka avkastningen i fonden. Investeringar i derivat kan innebära att fonden har en ökad känslighet för marknadsförändringar.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort), inval av underliggande fonder baserat på hållbarhetsanalys, samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning i underliggande fonder.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

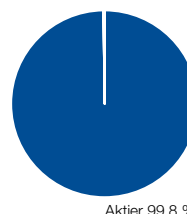
- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

## Information

Fondens avkastningshistorik före startdatum härleds från fusionen (19 oktober 2018) då handelsbanken Funds Pension 90 (Luxemburg) lades samman med Handelsbanken Pension 90 (Sverige).

## Marknadsexponering\*

Räntebärande inkl. likvida medel 0,2 %



\* Fondens placeringsfördelning inom marknaderna per 2023-06-30, i förhållande till fondens totala tillgångar vid detta datum.



Handelsbanken Pension 90, forts.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Pension 90 A1 - SEK	205,74	179,50	199,26	150,61	141,49	107,20	-	-	-	-
Pension 90 A13 - SEK	229,76	200,32	222,03	167,57	157,19	118,91	-	-	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	215	322	301	158	38	35	-	-	-	-
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	1 783	1 356	1 145	610	412	274	-	-	-	-
Pension 90 A1 - SEK	503	366	289	122	73	27	-	-	-	-
Pension 90 A13 - SEK	1 280	990	856	487	339	164	-	-	-	-
Antal andelar totalt, tusental	8 018	6 980	5 308	3 720	2 670	2 375	-	-	-	-
Pension 90 A1 - SEK	2 445	2 040	1 453	813	518	251	-	-	-	-
Pension 90 A13 - SEK	5 572	4 941	3 855	2 907	2 152	1 377	-	-	-	-
Total avkastning i %										
Pension 90 A1 - SEK	14,6	-9,9	32,3	6,4	32,0	-3,2	11,9	11,1	-	-
Pension 90 A13 - SEK	14,7	-9,8	32,5	6,6	32,2	-3,1	12,1	11,3	-	-
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Pension 90 A1 - SEK	14,0	-10,4	31,5	8,7	32,1	-2,7	12,6	11,9	-	-
Pension 90 A13 - SEK	14,0	-10,4	31,5	8,7	32,1	-2,7	12,6	11,9	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Pension 90 A1 - SEK	0,9	0,9	0,8	0,8	0,8	0,8	1,1	-	-	-
Pension 90 A13 - SEK	0,9	0,9	0,8	0,8	0,8	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Pension 90 A1 - SEK	7,3	9,2	18,7	18,5	13,0	4,1	11,5	-	-	-
Pension 90 A13 - SEK	7,5	9,3	18,8	18,7	13,2	4,3	11,7	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	6,5	8,5	19,6	19,8	13,4	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Pension 90 A1 - SEK	11,5	10,1	15,0	11,1	-	-	-	-	-	-
Pension 90 A13 - SEK	11,7	10,3	15,2	11,3	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	11,7	10,5	15,7	12,0	-	-	-	-	-	-

Historsikt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta – historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser.

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Nordic Index (50%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (50%).

T o m 2019-04-30: VINX Benchmark Cap SEK\_NI (50%), MSCI All Country World Index Net (50%).

T o m 2020-06-16: SIX SRI Nordic Index NI (50%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (50%).

T o m 2021-05-27: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index SIX SRI Nordic Index NI (50%), Solactive ISS ESG Screened Global Markets Index (50%).

T o m 2021-08-31: Solactive ISS ESG Screened Nordic All Cap Index (50%), Solactive ISS ESG Screened Paris Aligned Global Markets Index (50%).

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se information från fondbolaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Pension 90 A1	0,50
Pension 90 A13	0,35
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Pension 90 A1	0,50
Pension 90 A13	0,35
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Pension 90 A1	0,51
Pension 90 A13	0,36
Transaktionskostnader, tSEK	0
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00
Högst 3 % får tas ut i årlig fast avgift för förvaltningen av de underliggande fonder som fonden placerar medel i. Eventuellt förekommande prestationsbaserad förvaltningsavgift i de underliggande fonderna får på respektive mätperiod högst uppgå till 30 % av överavkastningen i förhållande till respektive fonds jämförelsenorm (index eller motsvarande)	

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,1
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	24,5
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått \*

Total risk % - A1 SEK	14,3	Aktiv avkastning % - A1 SEK	0,8
Total risk % - A13 SEK	14,3	Aktiv avkastning % - A13 SEK	0,9
Total risk i index % - A1 SEK	14,6	Informationskvot - A1 SEK	0,8
Total risk i index % - A13 SEK	14,6	Informationskvot - A13 SEK	1,0
Jämförelseindex		Sharpekvot - A1 SEK	0,5
Solactive ISS ESG		Sharpekvot - A13 SEK	0,5
Screened Paris Aligned Nordic Index (50%), Solactive ISS ESG		Sharpekvot i index - A1 SEK	0,4
Screened Paris Aligned Global Markets Index (50%)		Sharpekvot i index - A13 SEK	0,4

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Fondandelar	1 778 543	99,7	1 346 076	99,3
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde<sup>Not 1)</sup></b>	<b>1 778 543</b>	<b>99,7</b>	<b>1 346 076</b>	<b>99,3</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	-5 159	-0,3	6 985	0,5
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	502	0,0	392	0,0
Övriga tillgångar	14 884	0,8	8 226	0,6
<b>Summa tillgångar</b>	<b>1 788 770</b>	<b>100,3</b>	<b>1 361 679</b>	<b>100,4</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	558	0,0	447	0,0
Övriga skulder	4 764	0,3	5 404	0,4
<b>Summa skulder</b>	<b>5 322</b>	<b>0,3</b>	<b>5 852</b>	<b>0,4</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>1 783 448</b>	<b>100,0</b>	<b>1 355 828</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

Handelsbanken Pension 90, forts.

**Fondens innehav av finansiella instrument****Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 21,5**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
BÖRSHANDLADE AKTIEFONDER			
XACT Norden (UCITS ETF)	1 405 000	326 787	18,3
XACT Norden Högutdelande (UCITS ETF)	443 000	56 945	3,2
		<b>383 732</b>	<b>21,5</b>
Fondandelar		383 732	21,5

**Övriga finansiella instrument 78,2**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>FON DANDELAR</b>			
AKTIEFONDER			
SHB Emerging Market Index (A1 SEK)	410 127	77 466	4,3
SHB Europa Index Criteria (A1 SEK)	474 575	88 544	5,0
SHB Global Index Criteria (A1 SEK)	753 287	350 182	19,6
SHB Global Småbolag Index Criteria (A1 SEK)	496 633	82 070	4,6
SHB Norden Index Criteria (A1 SEK)	1 996 484	353 313	19,8
SHB Sverige Index Criteria (A1 SEK)	369 573	153 110	8,6
SHB USA Index Criteria (A1 SEK)	387 351	290 126	16,3
		<b>1 394 812</b>	<b>78,2</b>
Fondandelar		1 394 812	78,2
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>1 778 543</b>	<b>99,7</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		4 905	0,3
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>1 783 448</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

Vi godtar statsobligationer och statskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 2 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

-Goldman Sachs International  
-Svenska Handelsbanken



# Handelsbanken Realränta

## Placeringsinriktning

Fonden är en räntefond som huvudsakligen placerar i realränteobligationer, med målsättning att ge avkastningen ett skydd mot framtida svensk inflation. Fondens avkastning bestäms av hur de räntebärande instrument som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Fonden placerar i huvudsak i reala och nominella statsobligationer och statsskuldväxlar utgivna i svenska kronor som ingår i indexet OMRXREAL. Den genomsnittliga återstående räntebindningstiden för fondens placeringar skall uppgå till minst 2 år och maximalt 15 år. Fonden förvaltas med en genomsnittlig räntebindningstid som ligger nära den genomsnittliga räntebindningstiden i OMRXREAL. Fondens medel får placeras i räntebärande finansiella instrument med lägsta rating AA- från Standard & Poor's eller motsvarande Aa3 från Moody's. Vi jämför fondens utveckling mot OMRXREAL. Givet fondens syfte kommer fonden endast avvika från index i begränsad utsträckning. För mer information om andelsklassbeteckningen inom parentes och förvaltning i förhållande till fondens jämförelseindex och risknivå hänvisas till informationsbroschyren. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet, andelsklassbeteckningen inom parentes och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden sjönk med -0,5% under första halvåret 2023\*.

Utvecklingen för långa svenska realräntor under första halvåret var marginellt positiv vilket återspeglas i en svagt negativ utveckling för fondens avkastning för samma period. Fonden har under första halvåret 2023 varit placerad nära sitt referensindex, OMRX Realräntindex.

\* Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta. För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en räntefond som är riskklassificerad med 2 av 7, dvs. en låg riskklass. Det betyder att fonden har låg risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är förenat med ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindningstid har en högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindningstid. Fondens genomsnittliga återstående räntebindningstid kan variera mellan 2 till 15 år. Fondens placeringar är

koncentrerade till reala och nominella statsobligationer och statsskuldväxlar som är noterade i svenska kronor. Detta innebär att risken i fonden kan vara högre än en investering i en diversifierad global fond som fördelar sina investeringar över flera regioner, sektorer eller emittenter. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden investerar endast i räntebärande placeringar av hög kreditvärdighet, s.k. investment grade. Fondens placeringsinriktning innebär att fonden är exponerad mot realränteobligationer där likviditeten är lägre jämfört med räntemarknaden generellt. Detta kan komma att påverka fondens möjligheter att hantera stora utflöden till en begränsad kostnad. Fonden får som en del i sin placeringsinriktning investera i derivat i syfte att öka avkastningen i fonden. Investeringar i derivat kan innebära att fonden har en ökad känslighet för marknadsförändringar.

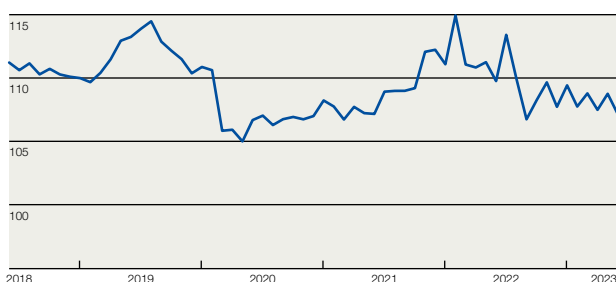
Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras genom att tillgångarna möter de exkluderingskriterier som fondbolaget tillämpar och följs upp av en egenutvecklad landsmodell.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta. Fonden kan ha flera andelsklasser, vilken som avses framgår av fondens fondfakta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK										
Realränta A1 - SEK	117,44	118,08	123,01	117,28	120,98	120,68	119,38	118,50	111,04	109,56
Realränta A9 - SEK	97,94	98,58	102,49	97,51	-	-	-	-	-	-
Realränta A10 - SEK	119,42	119,79	124,42	118,27	121,63	120,97	-	-	-	-
Realränta B1 - SEK	101,26	103,81	109,29	105,25	108,57	109,95	109,32	111,30	105,85	105,99
Fondens totala nettoutflöde, mnSEK	-35	-242	1 205	1 401	81	109	-1 609	263	415	1 003
Fondförmögenhet totalt, mnSEK	2 896	2 944	3 318	2 006	601	521	409	2 025	1 639	1 218
Realränta A1 - SEK	814	912	1 002	817	551	477	341	2 025	1 639	1 218
Realränta A9 - SEK	9	9	6	2	-	-	-	-	-	-
Realränta A10 - SEK	1 927	1 891	2 062	1 107	2	0	-	-	-	-
Realränta B1 - SEK	145	131	248	80	48	44	68	0	0	0
Antal andelar totalt, tusental	24 599	24 868	27 050	17 105	5 015	4 356	3 477	17 090	14 762	11 115
Realränta A1 - SEK	6 933	7 723	8 145	6 965	4 553	3 952	2 853	17 090	14 762	11 115
Realränta A9 - SEK	91	91	63	23	-	-	-	-	-	-
Realränta A10 - SEK	16 138	15 788	16 575	9 357	17	4	-	-	-	-
Realränta B1 - SEK	1 436	1 265	2 267	760	445	400	623	0	0	0

Handelsbanken Realränta, forts.

Total avkastning i % <sup>1)</sup>										
Realränta A1 - SEK	-0,5	-4,0	4,9	-3,1	0,2	1,1	0,7	6,7	1,4	6,7
Realränta A9 - SEK	-0,6	-3,8	5,1	-2,5	-	-	-	-	-	-
Realränta A10 - SEK	-0,3	-3,7	5,2	-2,8	0,5	1,4	1,0	7,0	1,7	7,0
Realränta B1 - SEK	-0,5	-4,0	4,9	-3,1	0,2	1,1	0,7	6,7	1,4	6,7
Jämförelseindex inklusive utdelning i %										
Realränta A1 - SEK	0,1	-3,7	5,2	-2,6	0,8	1,5	1,0	7,2	1,8	7,4
Realränta A9 - SEK	0,1	-3,7	5,2	-2,2	-	-	-	-	-	-
Realränta A10 - SEK	0,1	-3,7	5,2	-2,6	0,8	1,5	1,0	7,2	1,8	7,4
Realränta B1 - SEK	0,1	-3,7	5,2	-2,6	0,8	1,5	1,0	7,2	1,8	7,4
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)										
Realränta A1 - SEK	0,8	0,8	0,3	0,3	0,2	0,6	0,6	0,2	0,3	0,3
Realränta A9 - SEK	0,8	0,8	-	-	-	-	-	-	-	-
Realränta A10 - SEK	0,8	0,8	0,3	0,3	0,2	0,6	-	-	-	-
Realränta B1 - SEK	0,8	0,8	0,3	0,3	0,2	0,6	0,6	0,2	0,3	0,3
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %										
Realränta A1 - SEK	0,0	0,3	0,8	-1,4	0,7	0,9	3,7	4,0	4,0	0,4
Realränta A9 - SEK	0,1	0,5	-	-	-	-	-	-	-	-
Realränta A10 - SEK	0,3	0,6	1,1	-1,1	1,0	1,2	-	-	-	-
Realränta B1 - SEK	0,0	0,3	0,8	-1,4	0,7	0,9	3,7	4,0	4,0	0,4
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	0,6	0,7	1,3	-0,9	1,2	1,3	4,1	4,5	4,6	0,9
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %										
Realränta A1 - SEK	-0,7	-0,2	0,8	1,1	2,0	3,3	1,9	1,9	2,8	-
Realränta A10 - SEK	-0,4	0,1	1,1	1,4	2,3	3,6	-	-	-	-
Realränta B1 - SEK	-0,7	-0,2	0,8	1,1	2,0	3,3	1,9	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	-0,2	0,2	1,2	1,6	2,4	3,8	2,3	2,3	3,3	-
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %										
Realränta A1 - SEK	1,2	0,8	1,3	2,0	-	-	-	-	-	-
Realränta A10 - SEK	1,5	1,1	1,6	2,3	-	-	-	-	-	-
Realränta B1 - SEK	1,2	0,8	-	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	1,7	1,3	1,7	2,4	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK	2,12	1,16	1,06	0,00	1,65	0,55	2,78	1,59	1,59	1,51

Historiskt kan fonden haft flera andelsklasser som nu avslutats och inte finns under Fondfakta - historik. Därför kan både Antal andelar totalt, tusental samt Fondförmögenhet totalt avvika från summan av visade andelsklasser. 1) En justering har gjorts under 2023, vilket förklarar varför avkastningen mellan andelsklasserna skiljer sig åt. Justeringen påverkar inte det faktiska värdet i andelsklasserna.

Jämförelseindex: OMRX REAL

Fondens jämförelseindex utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgängsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För närmare beskrivning av andelsklassernas beteckning (nomenklaturen) se Information från fondbotaget.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	
Realränta A1	0,40
Realränta A9	0,20
Realränta A10	0,10
Realränta B1	0,40
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	
Realränta A1	0,40
Realränta A9	0,20
Realränta A10	0,10
Realränta B1	0,40
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	
Realränta A1	0,40
Realränta A9	0,20
Realränta A10	0,10
Realränta B1	0,40
Transaktionskostnader, tSEK	-
Transaktionskostnader i % av omsättningen	-

Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,0
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	11,5
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

Risk- och avkastningsmått\*

Total risk % - A1 SEK	6,6	Informationskvot - A9 SEK	Negativ
Total risk % - A9 SEK	6,6	Informationskvot - A10 SEK	Negativ
Total risk % - A10 SEK	6,5	Informationskvot - B1 SEK	Negativ
Total risk % - B1 SEK	6,5	Sharpekvot - A1 SEK	-0,1
Total risk i index % - A1 SEK	6,6	Sharpekvot - A9 SEK	-0,1
Total risk i index % - A9 SEK	6,6	Sharpekvot - A10 SEK	-0,1
Total risk i index % - A10 SEK	6,6	Sharpekvot - B1 SEK	-0,1
Total risk i index % - B1 SEK	6,6	Sharpekvot i index - A1 SEK	0,0
Jämförelseindex	OMRX REAL	Sharpekvot i index - A9 SEK	0,0
Aktiv avkastning % - A1 SEK	-0,6	Sharpekvot i index - A10 SEK	0,0
Aktiv avkastning % - A9 SEK	-0,5	Sharpekvot i index - B1 SEK	0,0
Aktiv avkastning % - A10 SEK	-0,2	Duration, år	4,8
Aktiv avkastning % - B1 SEK	-0,6	Spreadexponering %	0,0
Informationskvot - A1 SEK	Negativ		

\* Riskfiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
TILLGÅNGAR				
Överlåtbara värdepapper	2 882 705	99,5	2 935 127	99,7
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde<sup>Not 1)</sup></b>	<b>2 882 705</b>	<b>99,5</b>	<b>2 935 127</b>	<b>99,7</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	6 824	0,2	3 100	0,1
Förtbetalda kostnader och upplupna intäkter	12 321	0,4	5 883	0,2
<b>Summa tillgångar</b>	<b>2 901 850</b>	<b>100,2</b>	<b>2 944 110</b>	<b>100,0</b>
SKULDER				
Upplupna kostnader och förtbetalda intäkter	480	0,0	528	0,0
Övriga skulder	5 572	0,2	-	-
<b>Summa skulder</b>	<b>6 052</b>	<b>0,2</b>	<b>528</b>	<b>0,0</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>2 895 798</b>	<b>100,0</b>	<b>2 943 583</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

Fondens innehav av finansiella instrument

Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 99,5

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE RÅNTEBÄRANDE VÄRDEPAPPER</b>			
<b>STAT OCH KOMMUN</b>			
Statsobligation 3104 3,5% 2028-12-01	359 920	637 652	22,0
Statsobligation 3109 1% 2025-06-01	463 635	585 719	20,2
Statsobligation 3111 0,125% 2032-06-01	305 595	369 713	12,8
Statsobligation 3112 0,125% 2026-06-01	426 280	526 880	18,2
Statsobligation 3113 0,125% 2027-12-01	328 580	398 070	13,7
Statsobligation 3114 0,125% 2030-06-01	260 500	294 187	10,2
Statsobligation 3115 0,125% 2039-06-01	68 565	70 484	2,4
	<b>2 882 705</b>	<b>99,5</b>	
<b>Noterade räntebärande värdepapper</b>		<b>2 882 705</b>	<b>99,5</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>2 882 705</b>	<b>99,5</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		13 093	0,5
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>2 895 798</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

Sammanställning, företags- och koncernexponeringar\*

Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Svenska staten	99,5

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehåller mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

Förvaltare: CHRISTIAN SOPOV

BASVALUTA



# XACT BEAR (ETF)

Börshandlad indexfond med hävstång, noterad på Stockholmsbörsen

## Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad specialfond med hävstång och skiljer sig därför från en värdepappersfond. Fonden har som mål att ge en daglig avkastning som, före förvaltningsavgifter och andra transaktionskostnader, motsvarar cirka 150% av den dagliga motsatta förändringen i OMXS30-indexet (med OMXS30 avses det index som inkluderar utdelningar, OMXS30GI). Detta innebär att när OMXS30 faller med 1% en börsdag, stiger XACT Bear med cirka 1,5%. Indexet består av de 30 mest omsatta aktierna på OMX Nordic Exchange Stockholm. Fondens förmögenhet består av likvida medel och sålda terminskontrakt (OMXS30-futures) motsvarande cirka 150% av fondens värde. För att fonden ska bibehålla en exponering på -150% av fondförmögenheten, sker en daglig ombalansering av fondens terminsinnehav. Fondens avkastning bestäms av hur de terminskontrakt som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning.

## Portföljen

Fonden sjönk med -19,7% under första halvåret 2023\*. Portföljen består av två tillgångsslag: sålda terminer samt likvida medel som är placerade på räntebärande konto. Portföljen ombalanseras dagligen för att behålla samma hävstång och riskprofil.

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är riskklassificerad med 6 av 7, dvs. den näst högsta riskklassen. Det betyder att fonden har hög risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar sker främst på konto och i derivat och ger en negativ exponering mot Nasdaq OMXS30 motsvarande 150% av fondens värde. Detta innebär att den dagliga förväntade utvecklingen i fonden motsvarar 150% av rörelsen i index fast i motsatt riktning. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Sverige. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en

diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker dock i företag i flera sektorer eller branscher över tid bidrar till att minska risken i fonden. Fonden får som en del i sin placeringsinriktning investera i derivat i syfte att skapa avkastningen i fonden eller för skapa hävstång. Investeringar i derivat innebär att fonden har en ökad känslighet för marknadsförändringar.

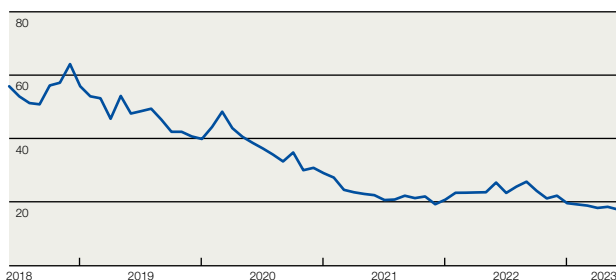
Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras ej då fondbolaget bedömer att det inte är möjligt med tanke på fondens placeringsinriktning

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 152,9%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 146,0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 149,7%

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK	19,32	24,06	21,12	33,62	44,39	69,23	66,34	76,54	97,51	108,69
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	17	53	85	28	198	-113	-27	161	-63	174
Fondförmögenhet, mnSEK	321	380	287	350	417	429	504	612	624	739
Antal andelar, tusental	16 600	15 800	13 600	10 400	9 400	6 200	7 600	8 000	6 400	6 800
Total avkastning i %	-19,7	13,9	-37,2	-24,3	-35,9	4,4	-13,3	-21,5	-10,3	-19,6
Jämförelseindex inklusive utdelning i %	15,9	-13,0	32,7	7,4	30,7	-7,0	7,7	9,4	2,2	14,0
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	42,7	44,2	41,8	46,8	39,3	28,2	24,6	37,0	35,1	22,8
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	-10,7	-15,4	-31,0	-30,3	-18,2	-4,9	-17,5	-16,1	-15,1	-24,8
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	4,4	7,5	19,9	18,5	10,2	0,0	8,5	5,8	7,9	19,6
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	-20,7	-18,4	-22,7	-19,2	-16,4	-12,5	-19,1	-21,0	-15,7	-20,3
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	11,3	8,6	13,5	9,0	7,9	5,0	11,5	13,2	8,5	12,9
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %	-19,5	-18,8	-21,8	-17,5	-18,4	-21,2	-17,9	-16,3	-17,1	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	10,8	10,0	13,3	8,7	10,4	11,9	7,7	6,6	7,8	-
Jämförelseindex: OMXS30™ Gross Index										

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,61
Transaktionskostnader, tSEK	411
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,0
Alternativ omsättningshastighet, ggr	-0,3
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	1,4
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

XACT BEAR (ETF), forts.

**Risk- och avkastningsmått \***

Total risk %	25,5	Informationskvot	Negativ
Total risk i index %	17,2	Sharpekvot	-0,4
Jämförelseindex	OMXS30™ Gross Index	Sharpekvot i index	0,2
Aktiv avkastning %	-15,1		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

**Balansräkning, tSEK**

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Bankmedel och övriga likvida medel	320 476	99,9	379 999	100,0
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	354	0,1	281	0,1
<b>Summa tillgångar</b>	<b>320 831</b>	<b>100,1</b>	<b>380 280</b>	<b>100,0</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	161	0,1	189	0,0
<b>Summa skulder</b>	<b>161</b>	<b>0,1</b>	<b>189</b>	<b>0,0</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>320 670</b>	<b>100,0</b>	<b>380 091</b>	<b>100,0</b>

**Fondens innehav av finansiella instrument****Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 0,0**

	Underliggande exponering tSEK	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
OMXS30 Future Jul 2023	-480 622	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		320 670	100,0
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>320 670</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

Fonden är inte i något avseende garanterad, godkänd, emitterad eller understödd av NASDAQ OMX Group. ("NASDAQ OMX") och NASDAQ OMX lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av OMXS30™ index kan ge upphov till eller med avseende på värdet av OMXS30™ index vid viss tidpunkt. NASDAQ OMX skall i intet fall vara ansvarig för fel i OMXS30™ index och skall inte heller vara skyldig att meddela eller offentliggöra eventuella fel i OMXS30™ index. OMX™.

OMXS30™ och OMXS30™ index är varumärken tillhörande NASDAQ OMX och används enligt licens från NASDAQ OMX.



# XACT BEAR 2 (ETF)

Börshandlad indexfond med hävstång, noterad på Stockholmsbörsen

## Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad specialfond med hävstång och skiljer sig därför från en värdepappersfond. Fonden har som mål att ge en daglig avkastning som, före förvaltningsavgifter och andra transaktionskostnader, motsvarar cirka 200% av den dagliga motsatta förändringen i OMXS30-indexet (med OMXS30 avses det index som inkluderar utdelningar, OMXS30GI). Detta innebär att när OMXS30 faller med 1% en börsdag, stiger XACT Bear 2 med cirka 2%. Indexet består av de 30 mest omsatta aktierna på OMX Nordic Exchange Stockholm. Fondens förmögenhet består av likvida medel och sålda terminskontrakt (OMXS30-futures) motsvarande cirka 200% av fondens värde. För att fonden ska bibehålla en exponering på -200% av fondförmögenheten, sker en daglig ombalansering av fondens terminsinnehav. Fondens avkastning bestäms av hur de terminskontrakt som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning.

## Portföljen

Fonden sjönk med -26,2% under första halvåret 2023\*. Portföljen består av två tillgångsslag: sålda terminer samt likvida medel som är placerade på räntebärande konto. Portföljen ombalanseras dagligen för att behålla samma hävstång och riskprofil.

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är riskklassificerad med 6 av 7, dvs. den näst högsta riskklassen. Det betyder att fonden har hög risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar sker främst på konto och i derivat och ger en negativ exponering mot NasdaqOMX30 motsvarande 200% av fondens värde. Detta innebär att den dagliga förväntade utvecklingen i fonden motsvarar 200% av rörelsen i index fast i motsatt riktning. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Sverige. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en

diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker i företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Fonden får som en del i sin placeringsinriktning investera i derivat i syfte att skapa avkastningen i fonden eller för skapa hävstång. Investeringar i derivat innebär att fonden har en ökad känslighet för marknadsförändringar.

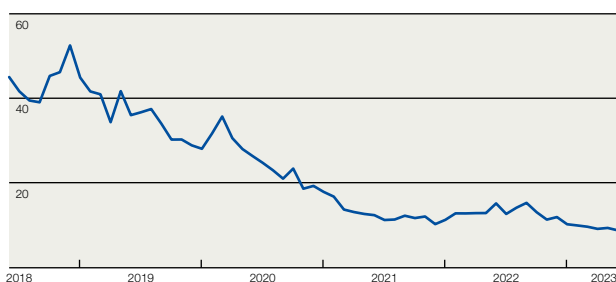
Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras ej då fondbolaget bedömer att det inte är möjligt med tanke på fondens placeringsinriktning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 203,0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 195,8%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 200,1%

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK	10,15	13,76	11,84	22,21	33,22	60,33	57,05	69,09	97,45	114,56
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	55	218	222	527	334	5	136	442	-126	299
Fondförmögenhet, mnSEK	680	839	521	748	643	709	616	573	448	676
Antal andelar, tusental	67 000	61 000	44 000	33 650	19 350	11 750	10 800	8 300	4 600	5 900
Total avkastning i %	-26,2	16,2	-46,7	-33,1	-44,9	5,7	-17,4	-29,1	-14,9	-25,8
Jämförelseindex inklusive utdelning i %	15,9	-13,0	32,7	7,4	30,7	-7,0	7,7	9,4	2,2	14,0
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	51,1	52,9	49,5	55,5	47,2	33,8	29,3	44,2	42,1	27,2
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	-15,7	-21,3	-40,3	-39,3	-23,7	-6,6	-23,5	-22,3	-20,6	-32,1
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	4,4	7,5	19,9	18,5	10,2	0,0	8,5	5,8	7,9	19,6
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	-27,8	-24,8	-29,7	-25,6	-21,9	-17,1	-25,5	-28,0	-21,9	-27,6
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	11,3	8,6	13,5	9,0	7,9	5,0	11,5	13,2	8,5	12,9
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %	-26,1	-25,1	-28,9	-23,8	-24,8	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	10,8	10,0	13,3	8,7	10,4	-	-	-	-	-
Jämförelseindex: OMXS30™ Gross Index										

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,60
Transaktionskostnader, tSEK	1 397
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,0
Alternativ omsättningshastighet, ggr	-1,7
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	1,4
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

XACT BEAR 2 (ETF), forts.

**Risk- och avkastningsmått \***

Total risk %	33,9	Informationskvot	Negativ
Total risk i index %	17,2	Sharpekvot	-0,5
Jämförelseindex	OMXS30™ Gross Index	Sharpekvot i index	0,2
Aktiv avkastning %	-20,1		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

**Balansräkning, tSEK**

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Bankmedel och övriga likvida medel	679 434	99,9	839 026	100,0
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	776	0,1	663	0,1
<b>Summa tillgångar</b>	<b>680 209</b>	<b>100,1</b>	<b>839 689</b>	<b>100,1</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	341	0,1	443	0,1
<b>Summa skulder</b>	<b>341</b>	<b>0,1</b>	<b>443</b>	<b>0,1</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>679 868</b>	<b>100,0</b>	<b>839 246</b>	<b>100,0</b>
<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	103 528	0,0	165 282	19,7

<sup>1)</sup> Likvida medel 103 528 tSEK

**Fondens innehav av finansiella instrument**

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES** **0,0**

	Underliggande exponering tSEK	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
OMXS30 Future Jul 2023	-1 365 661	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		679 868	100,0
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>679 868</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

Fonden är inte i något avseende garanterad, godkänd, emitterad eller understödd av NASDAQ OMX Group. ("NASDAQ OMX") och NASDAQ OMX lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av OMXS30™ index kan ge upphov till eller med avseende på värdet av OMXS30™ index vid viss tidpunkt. NASDAQ OMX skall i intet fall vara ansvarig för fel i OMXS30™ index och skall inte heller vara skyldig att meddela eller offentliggöra eventuella fel i OMXS30™ index.

OMX™, OMXS30™ och OMXS30™ index är varumärken tillhörande NASDAQ OMX och används enligt licens från NASDAQ OMX.



Förvaltare: CHRISTIAN SOPOV

BASVALUTA



# XACT BULL (ETF)

Börshandlad indexfond med hävstång, noterad på Stockholmsbörsen

## Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad specialfond med hävstång och skiljer sig därför från en värdepappersfond. Fonden har som mål att ge en daglig avkastning som, före förvaltningsavgifter och andra transaktionskostnader, motsvarar cirka 150% av den dagliga positiva förändringen i OMXS30-indexet (med OMXS30 avses det index som inkluderar utdelningar, OMXS30GI). Detta innebär att när OMXS30, stiger med 1% en börsdag, stiger XACT Bull med cirka 1,5%. Indexet består av de 30 mest omsatta aktierna på OMX Nordic Exchange Stockholm. Fondens förmögenhet består av likvida medel och terminskontrakt (OMXS30-futures) motsvarande cirka 150% av fondens värde. För att fonden ska bibehålla en exponering på 150% av fondförmögenheten, sker en daglig ombalansering av fondens terminsinnehav. Fondens avkastning bestäms av hur de terminskontrakt som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning.

## Portföljen

Fonden steg med 22,6% under första halvåret 2023\*. Portföljen består av två tillgångsslag: köpta terminer samt likvida medel som är placerade på räntebärande konto. Portföljen ombalanseras dagligen för att behålla samma hävstång och riskprofil.

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är riskklassificerad med 6 av 7, dvs. den näst högsta riskklassen. Det betyder att fonden har hög risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar sker främst på konto och i derivat och ger en exponering mot Nasdaq OMXS30 motsvarande 150% av fondens värde. Detta innebär att den dagliga förväntade utvecklingen i fonden motsvarar 150% av rörelsen i index. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Sverige. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond

som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker dock i företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Fonden får som en del i sin placeringsinriktning investera i derivat i syfte att skapa avkastningen i fonden eller för skapa hävstång. Investeringar i derivat innebär att fonden har en ökad känslighet för marknadsförändringar.

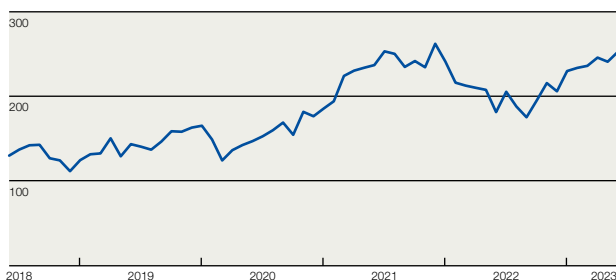
Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras ej då fondbolaget bedömer att det inte är möjligt med tanke på fondens placeringsinriktning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 150,7%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 149,4%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 150,0%

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK	696,13	567,92	722,62	486,67	449,71	307,91	346,43	314,17	278,70	274,85
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	35	-31	0	-49	-60	-119	-2	-119	-314	-569
Fondförmögenhet, mnSEK	418	312	434	292	292	246	381	346	418	673
Antal andelar, tusental	600	550	600	600	650	800	1 100	1 100	1 500	2 450
Total avkastning i %	22,6	-21,4	48,5	8,2	46,1	-11,1	10,3	12,7	1,4	19,1
Jämförelseindex inklusive utdelning i %	15,9	-13,0	32,7	7,4	30,7	-7,0	7,7	9,4	2,2	14,0
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	8,7	9,1	9,5	9,9	8,1	5,9	5,6	8,0	7,4	4,9
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	3,2	8,0	26,8	25,7	13,9	-1,0	11,5	6,9	9,9	27,9
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	4,4	7,5	19,9	18,5	10,2	0,0	8,5	5,8	7,9	19,6
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	14,2	10,4	18,1	11,8	10,3	5,9	15,6	17,8	9,7	16,2
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	11,3	8,6	13,5	9,0	7,9	5,0	11,5	13,2	8,5	12,9
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %	14,1	12,9	18,0	10,7	13,2	15,3	8,0	5,8	7,5	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	10,8	10,0	13,3	8,7	10,4	11,9	7,7	6,6	7,8	-

Jämförelseindex: OMXS30™ Gross Index

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,61
Transaktionskostnader, tSEK	308
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,0
Alternativ omsättningshastighet, ggr	-0,5
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	0,4
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

XACT BULL (ETF), forts.

**Risk- och avkastningsmått \***

Total risk %	25,9	Informationskvot	Negativ
Total risk i index %	17,2	Sharpekvot	0,1
Jämförelseindex	OMXS30™ Gross Index	Sharpekvot i index	0,2
Aktiv avkastning %	-1,2		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fonderportalen.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

**Balansräkning, tSEK**

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Bankmedel och övriga likvida medel	417 467	99,9	312 265	100,0
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	392	0,1	274	0,1
<b>Summa tillgångar</b>	<b>417 859</b>	<b>100,0</b>	<b>312 539</b>	<b>100,1</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	181	0,0	186	0,1
<b>Summa skulder</b>	<b>181</b>	<b>0,0</b>	<b>186</b>	<b>0,1</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>417 678</b>	<b>100,0</b>	<b>312 353</b>	<b>100,0</b>
<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	59 524	0,0	32 762	10,5

<sup>1)</sup> Likvida medel 59 524 tSEK

**Fondens innehav av finansiella instrument**

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES** **0,0**

	Underliggande exponering tSEK	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
OMXS30 Future Jul 2023	628 167	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		417 678	100,0
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>417 678</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

Fonden är inte i något avseende garanterad, godkänd, emitterad eller understödd av NASDAQ OMX Group. ("NASDAQ OMX") och NASDAQ OMX lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av OMXS30™ index kan ge upphov till eller med avseende på värdet av OMXS30™ index vid viss tidpunkt. NASDAQ OMX skall i intet fall vara ansvarig för fel i OMXS30™ index och skall inte heller vara skyldig att meddela eller offentliggöra eventuella fel i OMXS30™ index.

OMX™, OMXS30™ och OMXS30™ index är varumärken tillhörande NASDAQ OMX och används enligt licens från NASDAQ OMX.

Förvaltare: CHRISTIAN SOPOV

BASVALUTA



# XACT BULL 2 (ETF)

Börshandlad indexfond med hävstång, noterad på Stockholmsbörsen

## Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad specialfond med hävstång och skiljer sig därför från en värdepappersfond. Fonden har som mål att ge en daglig avkastning som, före förvaltningsavgifter och andra transaktionskostnader, motsvarar cirka 200% av den dagliga positiva förändringen i OMXS30-indexet (med OMXS30 avses det index som inkluderar utdelningar, OMXS30GI). Detta innebär att när OMXS30 stiger med 1% en börsdag, stiger XACT Bull 2 med cirka 2%. Indexet består av de 30 mest omsatta aktierna på OMX Nordic Exchange Stockholm. Fondens förmögenhet består av likvida medel och terminskontrakt (OMXS30-futures) motsvarande cirka 200% av fondens värde. För att fonden ska bibehålla en exponering på 200% av fondförmögenheten, sker en daglig ombalansering av fondens terminsinnehav. Fondens avkastning bestäms av hur de terminskontrakt som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning.

## Portföljen

Fonden steg med 30,0% under första halvåret 2023\*. Portföljen består av två tillgångsslag: köpta terminer samt likvida medel som är placerade på räntebärande konto. Portföljen ombalanseras dagligen för att behålla samma hävstång och riskprofil.

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är riskklassificerad med 6 av 7, dvs. den näst högsta riskklassen. Det betyder att fonden har hög risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar sker främst på konto och i derivat och ger en exponering mot Nasdaq OMXS30 motsvarande 200% av fondens värde. Detta innebär att den dagliga förväntade utvecklingen i fonden motsvarar 200% av rörelsen i index. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Sverige. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond

som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker dock i företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Fonden får som en del i sin placeringsinriktning investera i derivat i syfte att skapa avkastningen i fonden eller för skapa hävstång. Investeringar i derivat innebär att fonden har en ökad känslighet för marknadsförändringar.

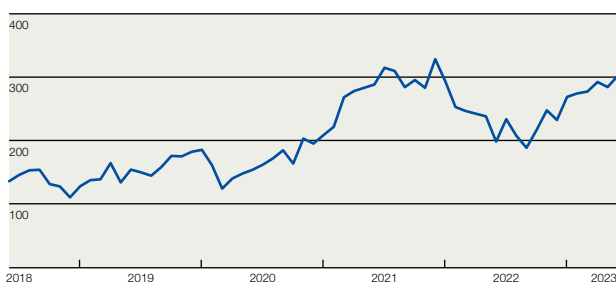
Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras ej då fondbolaget bedömer att det inte är möjligt med tanke på fondens placeringsinriktning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 201,4%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 199,0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 200,0%

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK	1 489,26	1 145,59	1 617,31	962,81	898,97	545,58	643,27	565,76	492,08	490,91
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	-14	-133	-162	71	-297	21	-238	-345	130	-460
Fondförmögenhet, mnSEK	745	573	970	674	494	518	579	707	960	835
Antal andelar, tusental	500	500	600	700	550	950	900	1 250	1 950	1 700
Total avkastning i %	30,0	-29,2	68,0	7,1	64,8	-15,2	13,7	15,0	0,2	25,2
Jämförelseindex inklusive utdelning i %	15,9	-13,0	32,7	7,4	30,7	-7,0	7,7	9,4	2,2	14,0
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	17,4	18,1	18,9	20,3	16,2	11,7	11,0	15,9	14,6	9,6
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	2,4	9,1	34,1	32,8	18,2	-1,8	14,3	7,4	12,0	37,5
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	4,4	7,5	19,9	18,5	10,2	0,0	8,5	5,8	7,9	19,6
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	17,3	12,2	23,4	14,4	12,9	6,8	19,9	22,5	11,0	19,7
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	11,3	8,6	13,5	9,0	7,9	5,0	11,5	13,2	8,5	12,9
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %	17,5	16,0	22,9	12,6	16,2	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	10,8	10,0	13,3	8,7	10,4	-	-	-	-	-
Jämförelseindex: OMXS30™ Gross Index										

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,60
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,60
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,60
Transaktionskostnader, tSEK	934
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,0
Alternativ omsättningshastighet, ggr	-1,8
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	0,6
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

XACT BULL 2 (ETF), forts.

**Risk- och avkastningsmått \***

Total risk %	34,6	Informationskvot	Negativ
Total risk i index %	17,2	Sharpekvot	0,0
Jämförelseindex	OMXS30™ Gross Index	Sharpekvot i index	0,2
Aktiv avkastning %	-2,0		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

**Balansräkning, tSEK**

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Bankmedel och övriga likvida medel	744 184	99,9	572 615	100,0
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	790	0,1	528	0,1
<b>Summa tillgångar</b>	<b>744 974</b>	<b>100,0</b>	<b>573 143</b>	<b>100,1</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	344	0,0	350	0,1
<b>Summa skulder</b>	<b>344</b>	<b>0,0</b>	<b>350</b>	<b>0,1</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>744 630</b>	<b>100,0</b>	<b>572 794</b>	<b>100,0</b>
<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	140 432	0,0	80 602	14,1

<sup>1)</sup> Likvida medel 140 432 tSEK

**Fondens innehav av finansiella instrument**

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES** **0,0**

	Underliggande exponering tSEK	Marknads- värde tSEK	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
OMXS30 Future Jul 2023	1 493 981	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		744 630	100,0
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>744 630</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

Fonden är inte i något avseende garanterad, godkänd, emitterad eller understödd av NASDAQ OMX Group. ("NASDAQ OMX") och NASDAQ OMX lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av OMXS30™ index kan ge upphov till eller med avseende på värdet av OMXS30™ index vid viss tidpunkt. NASDAQ OMX skall i intet fall vara ansvarig för fel i OMXS30™ index och skall inte heller vara skyldig att meddela eller offentliggöra eventuella fel i OMXS30™ index.

OMX™, OMXS30™ och OMXS30™ index är varumärken tillhörande NASDAQ OMX och används enligt licens från NASDAQ OMX.



# XACT Norden (UCITS ETF)

*Börshandlad indexfond, noterad på Stockholmsbörsen*

## Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Handelsbanken Nordic ESG Index så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,3%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet är återinvesterande, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet. Indexet består av de omkring 30 mest omsatta aktierna på de nordiska börserna vilka möter hållbarhetskraven i index. Det index som fonden följer innefattar hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven innefattar att index väljer bort bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer samt bolag som är verksamma inom kontroversiella sektorer såsom förbjudna vapen, kärnvapen, krigsmaterial, tobak, alkohol, cannabis, kommersiell spelverksamhet och pornografi. Hållbarhetskraven innefattar även att index väljer in bolag med höga hållbarhetsbetyg. Minst 75% av indexbolagen, mätt i totalt marknadsvärde av index, ska vara bedömda som ledare inom hållbarhet. Fonden placerar i aktier som ingår i detta index. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 7,3% under första halvåret 2023\*. Portföljen består av samtliga aktier som ingår i indexet Handelsbanken Nordic ESG Index. Vid halvårsskiftet var fondens största innehav Novo Nordisk, Investor och Atlas Copco. Största sektorvikter var hälsovård, industrivaror och -tjänster och finans. Hållbarhetskraven i index innebär dels att bolag med höga hållbarhetsbetyg ingår (väljs in), dels att bolag som är involverade i kontroversiella verksamheter inte får ingå (väljs bort).

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Norden. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker dock i företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Då fondens investeringar sker i utländska aktier denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

• Högsta hävstång under räkenskapsåret	0,4%
• Lägsta hävstång under räkenskapsåret	0,2%
• Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret	0,3%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

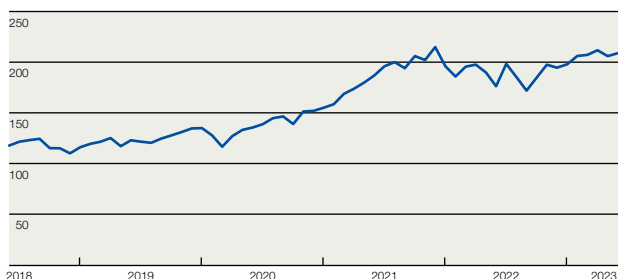
XACT Norden (UCITS ETF), forts.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de

hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

### Fondens utveckling \*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

### Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, EUR	19,74	18,39	20,31	14,38	12,74	10,42	11,31	10,43	10,77	9,42
Fondens totala nettovärde, mnEUR	36	205	-182	-146	188	113	44	121	47	163
Fondförmögenhet, mnEUR	1 898	1 726	1 662	1 338	1 322	915	880	768	662	549
Antal andelar, tusental	96 150	93 850	81 850	93 050	103 800	87 800	77 800	73 650	61 500	58 300
Total avkastning i %	7,3	-9,4	41,3	12,8	22,2	-7,8	8,4	-3,2	14,3	9,1
Jämförelseindex inklusive utdelning i %	7,4	-9,3	41,3	12,8	22,1	-8,0	8,4	-3,0	14,6	9,5
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	0,1	0,1	0,1	0,1	0,2	0,2	0,1	0,1	0,1	0,2
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	5,7	13,1	26,3	17,4	6,1	0,0	2,5	5,2	11,7	21,4
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	5,8	13,2	26,2	17,3	6,0	-0,1	2,6	5,4	12,0	22,2
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	12,1	10,2	14,3	5,9	6,2	3,8	9,9	12,4	9,6	11,1
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	12,1	10,2	14,2	5,9	6,2	4,0	10,2	12,8	9,9	11,5
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %	10,3	10,1	13,3	7,7	9,5	10,8	4,0	4,1	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	10,4	10,2	13,5	7,9	9,7	11,0	4,3	4,4	-	-
Omräkningskurs EUR/SEK	11,78	11,12	10,30	10,05	10,51	10,13	9,83	9,58	9,16	9,47

Jämförelseindex: Handelsbanken Nordic ESG Index

Tom 2019-06-19: VINX30™ Net

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

### Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,15
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,15
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,15
Transaktionskostnader, tEUR	146
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,01

### Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,3
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	2,6
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

### Risk- och avkastningsmått \*

Total risk %	19,0	Informationskvot	Negativ
Total risk i index %	18,9	Sharpekvot	0,3
Jämförelseindex	Handelsbanken Nordic ESG Index	Sharpekvot i index	0,3
Aktiv avkastning %	-0,1		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

### Balansräkning, tEUR

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	1 890 921	99,6	1 721 483	99,7
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>1 890 921</b>	<b>99,6</b>	<b>1 721 483</b>	<b>99,7</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	828	0,0	559	0,0
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	6 224	0,3	4 118	0,2
Övriga tillgångar	-	-	7 337	0,4
<b>Summa tillgångar</b>	<b>1 897 973</b>	<b>100,0</b>	<b>1 733 497</b>	<b>100,4</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	233	0,0	225	0,0
Övriga skulder	-	-	7 356	0,4
<b>Summa skulder</b>	<b>233</b>	<b>0,0</b>	<b>7 581</b>	<b>0,4</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>1 897 740</b>	<b>100,0</b>	<b>1 725 916</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	35 211	1,9	29 281	1,7
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	41 407	2,2	33 365	1,9
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	3 669	0,0	5 385	0,3

1) Likvida medel 3 669 tEUR

XACT Norden (UCITS ETF), forts.

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 99,6**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tEUR	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>DANMARK</b>			
A.P. Møller-Mærsk B	21 153	34 020	1,8
Coloplast B	336 525	38 561	2,0
Danske Bank	1 519 170	33 869	1,8
DSV	428 829	82 530	4,3
Genmab	165 378	57 303	3,0
Novo Nordisk	2 594 127	383 027	20,2
Novozymes	648 051	27 668	1,5
		<b>656 978</b>	<b>34,6</b>
<b>FINLAND</b>			
KONE	1 048 035	50 128	2,6
Nokia SEK	12 576 420	48 237	2,5
Nordea Bank	7 966 989	79 399	4,2
Sampo A	1 049 958	43 174	2,3
Stora Enso R	2 078 763	22 087	1,2
UPM-Kymmene	1 305 717	35 607	1,9
		<b>278 631</b>	<b>14,7</b>
<b>NORGE</b>			
DNB Bank	2 111 454	36 255	1,9
		<b>36 255</b>	<b>1,9</b>
<b>SVERIGE</b>			
ABB	688 434	24 776	1,3
Assa Abloy B	2 551 821	56 085	3,0
AstraZeneca	759 585	99 781	5,3
Atlas Copco A	9 213 093	121 494	6,4
Epiroc A	2 196 066	37 998	2,0
Ericsson B	7 857 378	38 946	2,1
Essity B	1 694 163	41 275	2,2
Handelsbanken A	3 634 470	27 863	1,5
Hennes & Mauritz B	1 713 393	26 925	1,4
Hexagon B	5 057 490	56 973	3,0
Investor B	7 647 771	139 953	7,4
NIBE Industrier B	4 628 661	40 221	2,1
Sandvik	2 517 207	44 900	2,4
SEB A	3 544 089	35 834	1,9
Swedbank A	2 580 666	39 824	2,1
Volvo B	4 555 587	86 208	4,5
		<b>919 057</b>	<b>48,4</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>1 890 921</b>	<b>99,6</b>

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 0,0**

	Underliggande exponering tEUR	Marknadsvärde tEUR	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
OMX Stockholm 30 ESG Jul 2023	6 274	0	0,0
Aktieindexterminer		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>1 890 921</b>	<b>99,6</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		6 819	0,4
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>1 897 740</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

**Volym utlånade värdepapper, tEUR 35 211**

**Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar 1,9**

**De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tEUR:**

Franska staten	1 681
Seven & I Holdings	1 300
BP	1 226
Unilever	1 226
AstraZeneca	1 226
Rio Tinto	1 226
Isui House	924
Shell	802
Glencore	713
Novartis	712

**De största motparterna för värdepapperslån, tEUR:**

BNP Paribas Arbitrage SNC	14 214
Barclays Capital Securities	13 767
Svenska Handelsbanken	10 276
SEB	3 149

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tEUR:**

Aktier	39 590
Obligationer och andra räntebärande instrument	1 817
<b>41 407</b>	

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, tEUR:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	-
En till tre månader	-
Tre månader till ett år	1
Mer än ett år	1 815
Obestämd löptid	39 590
<b>41 407</b>	

**Motparternas hemvist, tEUR**

Frankrike	14 214
Storbritannien	13 767
Sverige	13 426
<b>41 407</b>	

**Säkerheternas valuta, tEUR**

AUD	0
CHF	1 975
DKK	0
EUR	2 930
GBP	10 073
HKD	2 912
JPY	18 622
NZD	29
SEK	516
SGD	335
USD	4 016
<b>41 407</b>	

**Avveckling och clearing, tEUR**

Tredje part	41 407
<b>41 407</b>	

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 79 tEUR, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- SEB
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Svenska Handelsbanken AB (publ) ("Indexägaren") är inte ansvarig för förlust eller skada till följd av svensk eller utländsk lagstiftning, åtgärder från svenska eller utländska myndigheter, krig, strömbrott, telekommunikationsfel, brand, vattenskada, strejk, blockad, lockout, bojkott eller andra liknande omständigheter utanför indexägarens kontroll. Reservationen med avseende på strejk, blockad, lockout och bojkott gäller också om indexägaren vidtar eller är föremål för sådana konfliktåtgärder.

Indexägaren ansvarar inte under några omständigheter för förlust av data, utebliven vinst eller annan indirekt skada. Indexägaren ger inga uttryckliga eller implicita garantier angående resultaten som kan erhållas till följd av användningen av indexet eller angående indexets värde vid varje given tillfälle.

Indexägaren ska under inga omständigheter hållas ansvarig för fel i indexet och är ej skyldig att meddela eller publicera fel i indexet.



# XACT Nordic High Dividend Low Volatility (UCITS ETF)

*Börshandlad indexfond, noterad på Stockholmsbörsen*

## Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,2%. Förvaltningsavgift, kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilka inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Handelsbanken Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index (SEK) består av aktier i nordiska bolag som väljs in utifrån direktavkastning samt aktiernas risk och likviditet. Det index som fonden följer innefattar hållbarhetskrav. Bolag som inte uppfyller definierade krav avseende hållbarhet får inte ingå i index. Det index som fonden följer innefattar hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven innebär att index väljer bort bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer samt bolag med produktion eller distribution av fossila bränslen, krigsmateriel, tobak, cannabis, alkohol, kommersiell spelverksamhet och pornografi. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 4,8% under första halvåret 2023\*. Fonden består av samtliga aktier som ingår i indexet SHB Nordic High Dividend Low Volatility Criteria Index. I indexet ingår de 45 nordiska bolag som rankas bäst utifrån direktavkastning och låg volatilitet i aktiekursen. Det sammanvägda betyget bestämmer bolagens vikt till skillnad från traditionella index där börsvärdet bestämmer vikten. Vid halvårsskiftet var fondens största sektorvikt finans, material och industrivaror- och tjänster. Fondens största innehav var försäkringsbolaget Sampo, teleoperatören Telenor och banken DNB.

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till ett begränsat antal aktier utgivna i de nordiska länderna. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Då fondens investeringar sker i utländska aktier denominerade i annan valuta än fondens basvaluta är en investering i fonden förenad med valutarisk. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risk-nivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

• Högsta hävstång under räkenskapsåret	0,1%
• Lägsta hävstång under räkenskapsåret	0.0%
• Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret	0.0%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fonddrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans



XACT Nordic High Dividend Low Volatility (UCITS ETF), forts.

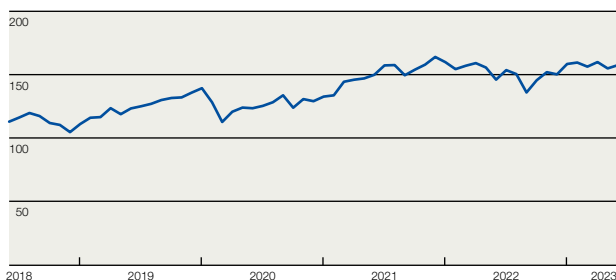
med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas

informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

### Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

### Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK	128,54	125,89	144,37	118,31	130,17	105,19	108,68	-	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	396	3 558	1 050	67	7 086	1 510	1 444	-	-	-
Fondförmögenhet, mnSEK	16 357	15 572	13 967	10 530	11 514	2 830	1 489	-	-	-
Antal andelar, tusental	127 250	123 700	96 750	89 000	88 450	26 900	13 700	-	-	-
Total avkastning i %	4,8	-8,4	27,0	-5,0	29,7	1,1	8,7	-	-	-
Jämförelseindex inklusive utdelning i %	4,9	-8,1	27,5	-4,7	30,0	1,3	9,1	-	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	2,5	7,9	9,8	11,0	14,5	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	2,8	8,2	10,2	11,3	14,8	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	6,9	7,7	-	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	7,2	8,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Utdelning per andel, SEK <sup>1)</sup>	3,34	6,52	5,36	5,20	5,60	5,00	-	-	-	-

1) Fonden har kvartalsvisa utdelningar och har delat ut två gånger under 2023.

Jämförelseindex: Handelsbanken Nordic High Div Low Vol

T o m 2018-06-27: SHB Nordic Smart Beta Index

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

### Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,30
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,30
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,30
Transaktionskostnader, tSEK	3 095
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,02

### Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,6
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	22,3
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

### Risk- och avkastningsmått\*

Total risk %	14,4	Informationskvot	Negativ
Total risk i index %	14,4	Sharpekvot	0,1
Jämförelseindex	Handelsbanken Nordic High Div Low Vol	Sharpekvot i index	0,1
Aktiv avkastning %	-0,3		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

### Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	16 248 693	99,3	15 499 075	99,5
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>16 248 693</b>	<b>99,3</b>	<b>15 499 075</b>	<b>99,5</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	31 963	0,2	29 049	0,2
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	80 844	0,5	48 413	0,3
Övriga tillgångar	-	-	50 118	0,3
<b>Summa tillgångar</b>	<b>16 361 500</b>	<b>100,0</b>	<b>15 626 656</b>	<b>100,3</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	4 309	0,0	4 059	0,0
Övriga skulder	-	-	50 355	0,3
<b>Summa skulder</b>	<b>4 309</b>	<b>0,0</b>	<b>54 414</b>	<b>0,3</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>16 357 190</b>	<b>100,0</b>	<b>15 572 242</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	495 994	3,0	675 658	4,3
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	587 408	3,6	742 314	4,8

XACT Nordic High Dividend Low Volatility (UCITS ETF), forts.

## Fondens innehav av finansiella instrument

**Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 99,3**

	<b>Antal/Nom. bel. tusental</b>	<b>Marknadsvärde tSEK</b>	<b>% av fondförm.</b>
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>DANMARK</b>			
Coloplast B	264 680	357 400	2,2
ISS	1 305 585	298 060	1,8
Sydbank	536 995	267 879	1,6
Tryg	1 778 955	415 701	2,5
		<b>1 339 041</b>	<b>8,2</b>
<b>FINLAND</b>			
Elisa	758 410	437 390	2,7
Huhtamaki	1 061 265	375 936	2,3
Kesko B	1 628 800	331 099	2,0
KONE	529 360	298 368	1,8
Nokia SEK	6 639 905	300 113	1,8
Nordea Bank	3 550 275	416 950	2,5
Orion	704 965	315 850	1,9
Sampo A	944 195	457 526	2,8
Stora Enso R	2 483 920	311 005	1,9
TietoEvry	1 313 220	391 215	2,4
UPM-Kymmene	1 061 265	341 043	2,1
		<b>3 976 494</b>	<b>24,3</b>
<b>NORGE</b>			
DNB Bank	2 295 590	464 499	2,8
Gjensidige Forsikring	2 453 380	424 943	2,6
Mowi	1 679 700	288 226	1,8
Norsk Hydro	4 751 515	305 630	1,9
Orkla	5 245 245	407 721	2,5
Storebrand	4 756 605	401 197	2,5
Telenor	4 189 070	459 504	2,8
Yara International	1 122 345	428 853	2,6
		<b>3 180 572</b>	<b>19,4</b>
<b>SVERIGE</b>			
ABB	872 935	370 212	2,3
Alfa Laval	753 320	296 055	1,8
Assa Abloy B	1 247 050	322 986	2,0
AstraZeneca	241 775	374 268	2,3
Axfood	1 539 725	351 365	2,1
Billerud	3 700 430	303 287	1,9
Ericsson B	5 431 030	317 226	1,9
Essity B	1 376 845	395 292	2,4
Handelsbanken A	4 171 255	376 831	2,3
Hexagon B	2 448 290	325 010	2,0
Holmen B1	921 290	356 908	2,2
Industrivärden C	1 320 855	392 558	2,4
Investor B	1 809 495	390 218	2,4
L E Lundbergföretagen B	674 425	309 426	1,9
SCA B	2 145 435	294 890	1,8
SEB A	2 954 745	352 058	2,2
Securitas	3 687 705	326 214	2,0
SSAB B	3 708 065	276 992	1,7
Swedbank A	1 992 735	362 379	2,2
Tele2 B	4 779 510	425 950	2,6
Telia	18 329 090	433 483	2,7
Volvo B	1 789 135	398 977	2,4
		<b>7 752 586</b>	<b>47,4</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>16 248 693</b>	<b>99,3</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>16 248 693</b>	<b>99,3</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Netto, övriga tillgångar och skulder</b>		<b>108 497</b>	<b>0,7</b>
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>16 357 190</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

## Uppgifter om fondens värdepapperslån

**Volym utlånade värdepapper, tSEK 495 994****Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar 3,1****De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:**

Rio Tinto	21 190
AstraZeneca	19 529
Franska staten	16 803
Barclays	16 447
London Stock Exchange Group	16 378
BP	15 607
Whitebread	12 591
Sse	12 203
Diageo	10 702
Novo Nordisk	10 702

**De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:**

J.P. Morgan Securities	214 050
Svenska Handelsbanken	181 158
Barclays Capital Securities	146 139
BNP Paribas Arbitrage SNC	27 897
Merrill Lynch International	10 277
Goldman Sachs International	5 733
HSBC Bank	2 153

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:**

Aktier	556 816
Obligationer och andra räntebärande instrument	30 591
	<b>587 408</b>

Vi godtar statsobligationer och statskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	-
En till tre månader	-
Tre månader till ett år	1 406
Mer än ett år	29 185
Obestäm d löptid	556 816
	<b>587 408</b>

**Motparternas hemvist, tSEK**

Frankrike	27 897
Storbritannien	378 352
Sverige	181 158
	<b>587 408</b>

**Säkerheternas valuta, tSEK**

AUD	1 156
CHF	6 100
DKK	18 594
EUR	60 274
GBP	242 380
HKD	7 395
JPY	162 129
NZD	56
SEK	24 856
SGD	657
USD	63 810
	<b>587 408</b>

**Avveckling och clearing, tSEK**

Tredje part	587 408
	<b>587 408</b>

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestäm d men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 750 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. I dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Svenska Handelsbanken AB (publ) ("Indexägaren") är inte ansvarig för förlust eller skada till följd av svensk eller utländsk lagstiftning, åtgärder från svenska eller utländska myndigheter, krig, strömbrott, telekommunikationsstörning, vattenskada, strejk, blockad, lockout, bojkott eller andra liknande omständigheter utanför indexägarens kontroll. Reservationen med avseende på strejk, blockad, lockout och bojkott gäller också om indexägaren vidtar eller är föremål för sådana konfliktåtgärder.

Indexägaren ansvarar inte under några omständigheter för förlust av data, utebliven vinst eller annan indirekt skada. Indexägaren ger inga uttryckliga eller implicita garantier angående resultaten som kan erhållas till följd av användningen av indexet eller angående indexets värde vid varje given tillfälle.

Indexägaren ska under inga omständigheter hållas ansvarig för fel i indexet och är ej skyldig att meddela eller publicera fel i indexet.



# XACT Obligation (UCITS ETF)

Börshandlad indexfond, noterad på Stockholmsbörsen

## Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Handelsbanken Sweden All Bond Tradable Index så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de räntebärande instrument som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet kommer att efterbildas genom fysisk replikering. Den valda metoden för efterbildning innebär att fonden placerar direkt i de värdepapper som ingår i indexet, dvs. full replikering. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,2%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet efterbildar utvecklingen av en korg av obligationer som representerar den svenska marknaden för säkerställda bostadsobligationer samt obligationer emitterade av stat och kommun, med benchmarkstatus. Mer information om indexet finns på [www.handelsbanken.se/index](http://www.handelsbanken.se/index). Där återfinns bl.a. ytterligare uppgifter om sammansättningen av index samt metoden för viktning och rebalansering. Fonden kan placera i OTC-derivat (såsom swappar och terminer) för att få en så god följsamhet som möjligt mot detta index. Fonden har genom placeringsinriktningen inte möjlighet att investera i företagsobligationer vilket gör att kontroversiella branscher per definition är exkluderade. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 0,2% under första halvåret 2023\*.

Fonden följer indexet Handelsbanken Sweden All Bond Tradable Index vars syfte är att spegla den svenska marknaden för säkerställda bostadsobligationer samt obligationer emitterade av stat och kommun, med benchmarkstatus. Fondens största samlade innehav var vid halvårsskiftet obligationer emitterade av Svenska staten samt säkerställda obligationer från SHB Stadshypotek och Nordea Hypotek.

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en räntefond som är riskklassificerad med 2 av 7, dvs. en låg riskklass. Det betyder att fonden har låg risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. En placering i räntebärande värdepapper eller i en räntefond är i första hand förenat med ränterisk vilket innebär att när den allmänna räntenivån stiger sjunker värdet på ett räntebärande värdepapper vilket påverkar fondens avkastning negativt. En fond som placerar i räntebärande instrument med lång återstående räntebindningstid har en

högre ränterisk än en fond som placerar i räntebärande instrument med kortare återstående räntebindningstid. Fondens genomsnittliga återstående räntebindningstid kan variera väsentligt över tid. Fonden är en indexfond som följer Handelsbanken Sweden All Bond Tradable Index. Handelsbanken Sweden All Bond Tradable Index är ett marknadsvikttat index vars syfte är att spegla den svenska marknaden för säkerställda bostadsobligationer samt obligationer emitterade av stat och kommun. Fondens geografiska koncentration innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global räntefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. En placering i ett räntebärande instrument innebär en kreditrisk då fonden kan drabbas av en förlust till följd av att en emittent inte fullföljer sina förpliktelser. Kreditrisken är högre när fondens andel av tillgångar i räntebärande värdepapper emitterade av företag eller stater med lägre kreditkvalitet ökar. Fonden investerar endast i räntebärande placeringar av hög kreditvärdighet, s.k. investment grade.

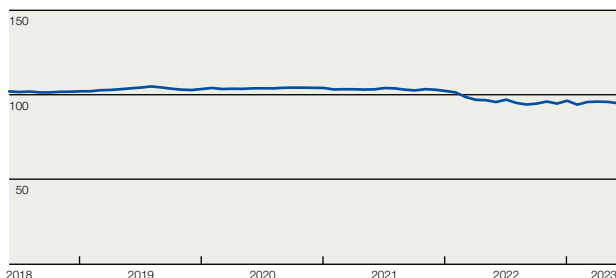
Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras genom sitt val av index i vilket underliggande tillgångar möter de exkluderingskriterier som tillämpas av fondbolaget.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0.0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0.0%

## Fondens utveckling \*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK	95,51	95,28	103,52	104,64	103,34	102,32	101,40	101,13	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	810	811	1 432	788	493	102	0	405	-	-
Fondförmögenhet, mnSEK	4 546	3 735	3 220	1 815	1 013	517	411	410	-	-
Antal andelar, tusental	47 600	39 200	31 100	17 350	9 800	5 050	4 050	4 050	-	-
Total avkastning i %	0,2	-8,0	-1,1	1,3	1,0	0,9	0,3	1,1	-	-
Jämförelseindex inklusive utdelning i %	0,3	-7,9	-1,0	1,3	1,1	1,0	0,4	1,2	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	0,1	0,1	0,0	0,1	0,1	0,0	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	-4,0	-4,6	0,1	1,1	1,0	0,6	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	-4,0	-4,5	0,1	1,2	1,1	0,7	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	-1,4	-1,2	0,5	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	-1,3	-1,2	0,6	-	-	-	-	-	-	-

Jämförelseindex: Handelsbanken Sweden All Bond Tradable Index

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsinriktning, tillgångsslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

XACT Obligation (UCITS ETF), forts.

**Fondfakta - kostnader**

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,10
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,10
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,10

**Fondfakta - övriga nyckeltal**

Omsättningshastighet, ggr	0,3
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	42,6
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

**Risk- och avkastningsmätt \***

Total risk %	4,3	Sharpekvot	-1,1
Total risk i index %	4,3	Sharpekvot i index	-1,1
Jämförelseindex	Handelsbanken Sweden	Duration, år	3,6
	All Bond Tradable Index	Spreadexponering %	2,1
Aktiv avkastning %	0,0		
Informationskvot	Negativ		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

**Balansräkning, tSEK**

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	4 517 964	99,4	3 715 611	99,5
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not.1)</sup>	<b>4 517 964</b>	<b>99,4</b>	<b>3 715 611</b>	<b>99,5</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	796	0,0	483	0,0
Förtutbetalda kostnader och upplupna intäkter	28 070	0,6	19 359	0,5
<b>Summa tillgångar</b>	<b>4 546 830</b>	<b>100,0</b>	<b>3 735 452</b>	<b>100,0</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förtutbetalda intäkter	368	0,0	324	0,0
<b>Summa skulder</b>	<b>368</b>	<b>0,0</b>	<b>324</b>	<b>0,0</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>4 546 463</b>	<b>100,0</b>	<b>3 735 128</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

**Fondens innehav av finansiella instrument****Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 99,4**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
--	--------------------------	--------------------	----------------

**NOTERADE RÄNTEBÄRANDE VÄRDEPAPPER****BOSTAD**

Danske Hypotek 0,5% 2026-12-16	58 000	51 542	1,1
Danske Hypotek 2412 1% 2024-12-18	52 000	49 733	1,1
Danske Hypotek 2512 1% 2025-12-17	62 000	57 611	1,3
Danske Hypotek 3,5% 2027-12-15	30 000	29 413	0,6
Danske Hypotek AB 3,5% 2028-12-20	8 000	7 798	0,2
Länsförsäkringar Hyp 517 1,5% 2024-09-18	56 600	54 848	1,2
Länsförsäkringar Hyp 518 1,25% 2025-09-17	65 900	62 004	1,4
Länsförsäkringar Hyp 519 1,5% 2026-09-16	76 400	70 721	1,6
Länsförsäkringar Hyp 520 1% 2027-09-15	54 300	48 232	1,1
Länsförsäkringar Hyp 521 0,5% 2028-09-20	51 200	42 929	0,9
Länsförsäkringar Hyp 522 3% 2029-09-19	16 000	15 101	0,3
Nordea Hypotek 5534 1% 2024-09-18	163 500	157 501	3,5
Nordea Hypotek 5535 1% 2025-09-17	160 300	149 999	3,3
Nordea Hypotek 5536 0,5% 2026-09-16	129 400	115 990	2,6
Nordea Hypotek 5537 1% 2027-06-16	114 000	101 918	2,2
Nordea Hypotek 5538 3,5% 2028-09-20	40 000	39 144	0,9
SCBC 146 0,5% 2025-06-11	104 000	97 138	2,1
SCBC 147 2% 2026-06-17	109 000	102 967	2,3
SCBC 148 0,25% 2027-06-09	122 000	105 858	2,3
SCBC 149 3,5% 2028-06-14	18 000	17 650	0,4
SCBC 151 1% 2030-06-12	38 000	31 190	0,7
SCBC 153 0,75% 2032-06-09	12 000	9 059	0,2
Stadshypotek 1589 1,5% 2024-12-03	144 000	138 852	3,1
Stadshypotek 1590 1% 2025-09-03	150 000	140 580	3,1
Stadshypotek 1591 0,5% 2026-06-01	154 000	139 356	3,1
Stadshypotek 1592 1% 2027-03-01	154 000	138 725	3,1
Stadshypotek 1593 2,5% 2027-12-01	120 000	113 094	2,5
Stadshypotek 1594 2% 2028-09-01	112 000	101 931	2,2
Swedbank Hypotek 194 1% 2024-09-18	123 600	119 065	2,6
Swedbank Hypotek 195 1% 2025-06-18	125 300	118 095	2,6
Swedbank Hypotek 196 1% 2026-03-18	95 700	88 344	1,9
Swedbank Hypotek 197 1% 2027-03-17	86 300	77 629	1,7
Swedbank Hypotek 198 3% 2028-03-15	25 200	24 199	0,5
		<b>2 618 219</b>	<b>57,6</b>

**STAT OCH KOMMUN**

Kommuninvest 1% 2024-10-02	100 380	96 767	2,1
Kommuninvest 1% 2025-05-12	97 730	92 666	2,0
Kommuninvest 1% 2026-11-12	109 290	99 605	2,2
Statsobligation 1053 3,5% 2039-03-30	88 840	98 497	2,2

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
Statsobligation 1056 2,25% 2032-06-01	110 810	108 202	2,4
Statsobligation 1058 2,5% 2025-05-12	169 325	166 443	3,7
Statsobligation 1059 1% 2026-11-12	177 075	165 639	3,6
Statsobligation 1060 0,75% 2028-05-12	140 760	127 975	2,8
Statsobligation 1061 0,75% 2029-11-12	135 840	120 937	2,7
Statsobligation 1062 0,125% 2031-05-12	102 925	85 153	1,9
Statsobligation 1063 0,5% 2045-11-24	33 845	21 776	0,5
Statsobligation 1064 1,375% 2071-06-23	19 475	11 751	0,3
Statsobligation 1065 1,75% 2033-11-11	60 120	55 971	1,2
		<b>1 251 381</b>	<b>27,5</b>

**ÖVRIGA**

Kommuninvest 0,5% 2027-06-15	69 500	61 284	1,3
Kommuninvest 0,75% 2026-02-04	96 680	89 339	2,0
Kommuninvest 0,75% 2028-05-12	70 890	61 563	1,4
Kommuninvest 3,25% 2029-11-12	13 350	12 944	0,3
Kommuninvest 3% 2029-03-12	13 810	13 269	0,3
SEB Bolån 579 1% 2024-12-18	116 000	110 959	2,4
SEB Bolån 580 1% 2025-12-17	104 000	96 626	2,1
SEB Bolån 581 0,5% 2026-12-16	108 000	96 023	2,1
SEB Bolån 584 1% 2029-12-19	8 000	6 637	0,1
SEB Bolån 601 3% 2027-12-06	78 000	74 945	1,6
SEB Bolån 602 3% 2028-11-06	26 000	24 774	0,5
		<b>648 364</b>	<b>14,3</b>

**Noterade räntebärande värdepapper 4 517 964 99,4**

<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>	<b>4 517 964</b>	<b>99,4</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>	<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder	28 499	0,6
<b>Totalt summa fondförmögenhet</b>	<b>4 546 463</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Sammanställning, företags- och koncernexponeringar \***

Företag/koncern	% av fondförmögenheten	Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Svenska staten	21,2	SEB	9,0
Stadshypotek	17,0	The Swedish Covered Bond Corporation	8,0
Nordea Hypotek	12,4	Länsförsäkringar Hypotek	6,5
Kommuninvest i Sverige	11,6	Danske Hypotek AB	4,3
Swedbank Hypotek	9,4		

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonder innehåller mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

Svenska Handelsbanken AB (publ) ("Indexägaren") är inte ansvarig för förlust eller skada till följd av svensk eller utländsk lagstiftning, åtgärder från svenska eller utländska myndigheter, krig, strömavbrott, telekommunikationsfel, brand, vattenskada, strejk, blockad, lockout, bojkott eller andra liknande omständigheter utanför indexägarens kontroll. Reservationen med avseende på strejk, blockad, lockout och bojkott gäller också om indexägaren vidtar eller är föremål för sådana konfliktåtgärder.

Indexägaren ansvarar inte under några omständigheter för förlust av data, utebliven vinst eller annan indirekt skada. Indexägaren ger inga uttryckliga eller implicita garantier angående resultatet som kan erhållas till följd av användningen av indexet eller angående indexets värde vid varje givet tillfälle.

Indexägaren ska under inga omständigheter hållas ansvarig för fel i indexet och är ej skyldig att meddela eller publicera fel i indexet.



# XACT OMXC25 (UCITS ETF)

*Börshandlad indexfond, noterad på Köpenhamnsbörsen*

## Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet OMX Copenhagen 25 GI Index så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,2%. Förvaltningsavgift, kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilka inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. OMX Copenhagen 25 GI Index är ett marknadsvärdesviktat index bestående av de 25 mest omsatta aktierna på Copenhagen Stock Exchange. Fonden placerar i aktier som ingår i detta index. Inom ramen för fondens placeringsinriktning beaktas internationella normer och riktlinjer för miljö, socialt ansvar och ägarstyrning. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 8,1% under första halvåret 2023\*.

Portföljen består av samtliga aktier som ingår i indexet OMX Copenhagen 25 Index GI. Vid halvårsskiftet var fondens största innehav Novo Nordisk, DSV och Vestas Wind Systems. Största sektorvikter var hälsovård, industrivaror och -tjänster och finans.

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till ett begränsat antal aktier utgivna i Danmark. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fonden får placera i derivat som ett led i placeringsinriktningen men användningen av derivat är inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras genom sitt val av index i vilket underliggande aktier möter de exkluderingskriterier som tillämpas av fondbolaget.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0,6%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0,0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0,1%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

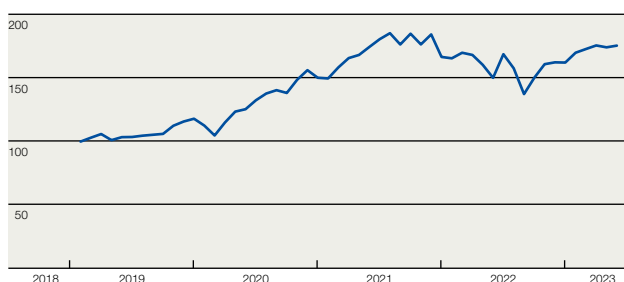
Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

XACT OMXC25 (UCITS ETF), forts.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, DKK	184,36	170,52	193,64	164,03	121,51	-	-	-	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnDKK	55	466	551	566	121	-	-	-	-	-
Fondförmögenhet, mnDKK	2 148	1 935	1 656	894	140	-	-	-	-	-
Antal andelar, tusental	11 650	11 350	8 550	5 450	1 150	-	-	-	-	-
Total avkastning i %	8,1	-11,9	18,0	35,0	21,5	-	-	-	-	-
Jämförelseindex inklusive utdelning i %	8,7	-11,5	18,6	35,6	21,9	-	-	-	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	0,3	0,2	0,1	-	-	-	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	0,3	2,0	26,2	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	0,9	2,4	26,8	-	-	-	-	-	-	-
Omräkningskurs DKK/SEK	1,58	1,50	1,38	1,35	1,41	-	-	-	-	-

Jämförelseindex: OMX Copenhagen 25 GI Index

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,20
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,20
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,21
Transaktionskostnader, tDKK	80
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,01

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,1
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	48,6
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk %	20,6	Informationskvot	Negativ
Total risk i index %	20,7	Sharpekvot	0,3
Jämförelseindex OMX Copenhagen 25 GI Index		Sharpekvot i index	0,4
Aktiv avkastning %	-0,6		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden.

## Balansräkning, tDKK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	2 138 577	99,6	1 926 217	99,5
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> (Not 1)	<b>2 138 577</b>	<b>99,6</b>	<b>1 926 217</b>	<b>99,5</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	191	0,0	2 972	0,2
Förtutbetalda kostnader och upplupna intäkter	9 459	0,4	6 553	0,3
<b>Summa tillgångar</b>	<b>2 148 227</b>	<b>100,0</b>	<b>1 935 742</b>	<b>100,0</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förtutbetalda intäkter	376	0,0	337	0,0
<b>Summa skulder</b>	<b>376</b>	<b>0,0</b>	<b>337</b>	<b>0,0</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>2 147 851</b>	<b>100,0</b>	<b>1 935 405</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

<b>POSTER INOM LINJEN</b>				
Utlånade finansiella instrument	167 094	7,8	191 897	9,9
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	193 020	9,0	214 200	11,1
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument	-	-	186	0,0

## Fondens innehav av finansiella instrument

## Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 99,6

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknads- värde tDKK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>DANMARK</b>			
A.P. Møller-Mærsk A	3 961	47 057	2,2
A.P. Møller-Mærsk B	4 893	58 594	2,7
Ambu B	212 030	23 673	1,1
Bavarian Nordic	88 540	17 177	0,8
Carlsberg B	103 219	112 560	5,2
Chr. Hansen Holding	114 403	54 181	2,5
Coloplast B	157 741	134 585	6,3
Danske Bank	778 220	129 185	6,0
Dong Energy	241 388	155 647	7,2
DSV	202 943	290 817	13,5
FLSmidth	50 794	16 772	0,8
Genmab	73 628	189 960	8,8
GN Store Nord	137 936	23 477	1,1
ISS	174 051	25 107	1,2
Jyske Bank	52 658	27 298	1,3
Netcompany Group	51 027	14 410	0,7
Novo Nordisk	292 415	321 481	15,0
Novozymes	221 117	70 293	3,3
Pandora Holding	92 967	56 635	2,6
Rockwool B	10 252	18 074	0,8
Royal Unibrew	47 765	29 137	1,4
Tryk	364 645	53 840	2,5
Vestas Wind Systems	1 160 340	210 555	9,8
William Demant	110 209	31 795	1,5
		<b>2 112 310</b>	<b>98,3</b>
<b>FINLAND</b>			
Nordea Bank CPH	352 529	26 267	1,2
		<b>26 267</b>	<b>1,2</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>2 138 577</b>	<b>99,6</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>2 138 577</b>	<b>99,6</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		9 274	0,4
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>2 147 851</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

## Sammanställning, företags- och koncernexponeringar\*

## Företag/koncern % av fondförmögenheten

AP Møller Maersk	4,9
------------------	-----

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehar mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

XACT OMXC25 (UCITS ETF), forts.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

<b>Volym utlånade värdepapper, tDKK</b>	<b>167 094</b>
---	----------------

<b>Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar</b>	<b>7,8</b>
--	------------

**De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tDKK:**

Brittiska staten	57 138
Amerikanska staten	24 243
Franska staten	20 404
Rio Tinto	3 329
AstraZeneca	3 278
BP	3 157
Unilever	2 998
Shell	2 869
Barclays	2 753
London Stock Exchange Group	2 751

**De största motparterna för värdepapperslån, tDKK:**

Barclays Capital Securities	79 786
Svenska Handelsbanken	50 326
Merrill Lynch International	13 918
BNP Paribas Arbitrage SNC	12 389
Goldman Sachs International	12 103
Morgan Stanley & Co. International	7 874
J.P. Morgan Securities	7 106
UBS AG London Branch	6 747
HSBC Bank	2 773

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tDKK:**

Aktier	90 287
Obligationer och andra räntebärande instrument	102 733

**193 020**

Vi godtar statsobligationer och statskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, tDKK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	20
En till tre månader	13
Tre månader till ett år	13 702
Mer än ett år	88 999
Obestämmd löptid	90 287

**193 020****Motparternas hemvist, tDKK**

Frankrike	12 389
Storbritannien	130 306
Sverige	50 326

**193 020****Säkerheternas valuta, tDKK**

AUD	154
CHF	1 914
DKK	575
EUR	26 035
GBP	94 561
HKD	2 294
JPY	27 530
NZD	30
SEK	3 013
SGD	222
USD	36 692

**193 020****Avveckling och clearing, tDKK**

Tredje part	193 020
-------------	---------

**193 020**

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämmd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 645 tDKK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende garanterad, godkänd, emitterad eller understödd av Nasdaq, Inc. eller dess dotterbolag ("bolagen"). Bolagen lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av OMX Copenhagen 25 Index kan ge upphov till eller med avseende på värdet av indexet vid viss tidpunkt. Bolagen skall i intet fall vara ansvariga för fel i OMX Copenhagen 25 Index och skall inte heller vara skyldiga att meddela eller offentliggöra eventuella fel i indexet.

OMX Copenhagen 25 Index är varumärke tillhörande Nasdaq, Inc. och används enligt licens från Nasdaq, Inc.



# XACT OMXS30 ESG (UCITS ETF)

*Börshandlad indexfond, noterad på Stockholmsbörsen*

## Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet OMX Stockholm 30 ESG Responsible Index så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,2%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet består av de 30 mest omsatta aktierna på Nasdaq Stockholm (Stockholmsbörsen) exklusive de bolag som inte uppfyller index hållbarhetskrav. Det index som fonden följer innefattar hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven innebär att index väljer bort bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer samt bolag med produktion eller distribution av fossila bränslen, krigsmateriel, tobak, cannabis, alkohol, kommersiell spelverksamhet och pornografi. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 14,9% under första halvåret 2023\*.

Portföljen består av samtliga aktier som ingår i indexet. Vid halvårsskiftet var de tre största innehaven Atlas Copco, Investor och Volvo. OMX Stockholm 30 ESG Responsible Index omviktas två gånger per år: sista juni och sista december. Inga bolag tillkom eller utgick sista juni.

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 4 av 7, dvs. en medelriskklass. Det betyder att fonden har medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Sverige. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker dock i företag i flera sektorer eller branscher vilket över tid bidrar till att minska risken i fonden. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

• Högsta hävstång under räkenskapsåret	1,7%
• Lägsta hävstång under räkenskapsåret	0,2%
• Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret	0,4%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjuda en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

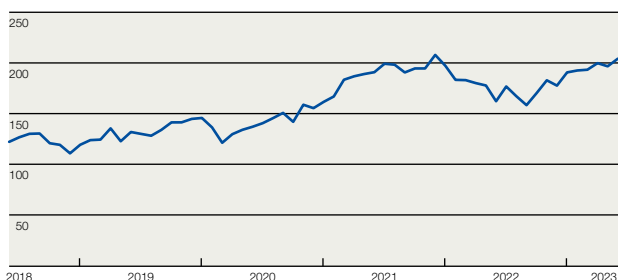
Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas



XACT OMXS30 ESG (UCITS ETF), forts.

informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK	312,85	272,29	318,55	238,29	222,10	170,20	183,32	170,31	155,94	152,73
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	677	-1 321	-980	-2 265	-2 096	-1 243	318	-162	-187	-3 179
Fondförmögenhet, mnSEK	8 259	6 589	9 190	7 613	9 461	9 378	11 494	10 380	9 754	9 821
Antal andelar, tusental	26 400	24 200	28 850	31 950	42 600	55 100	62 700	60 950	62 550	64 300
Total avkastning i %	14,9	-14,5	33,7	7,3	30,5	-7,2	7,6	9,2	2,1	13,6
Jämförelseindex inklusive utdelning i %	14,9	-14,1	33,9	7,4	30,7	-7,0	7,7	9,4	2,2	14,0
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	0,2	0,2	0,1	0,1	0,1	0,1	0,0	0,0	0,0	0,0
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	3,4	6,9	19,8	18,3	10,1	0,0	8,4	5,6	7,7	19,2
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	3,7	7,2	19,9	18,5	10,2	0,0	8,5	5,8	7,9	19,6
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	10,8	8,2	13,3	8,9	7,8	4,8	11,3	12,9	8,2	12,6
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	11,0	8,5	13,5	9,0	7,9	5,0	11,5	13,2	8,5	12,9
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %	10,4	9,7	13,1	8,5	10,1	11,6	7,5	6,3	7,5	10,4
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	10,6	10,0	13,3	8,7	10,4	11,9	7,7	6,6	7,8	10,8

T o m 2021-07-01: OMXS30™ Gross Index

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fonddrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,10
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,10
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,11
Transaktionskostnader, tSEK	209
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,5
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	7,0
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaldade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk %	17,3	Informationskvot	Negativ
Total risk i index %	17,3	Sharpekvot	0,2
Jämförelseindex	OMX Stockholm 30 ESG Responsible Index	Sharpekvot i index	0,2
Aktiv avkastning %	-0,3		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fonddrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	8 245 180	99,8	6 568 868	99,7
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>8 245 180</b>	<b>99,8</b>	<b>6 568 868</b>	<b>99,7</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	2 455	0,0	6 694	0,1
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	11 896	0,1	8 473	0,1
Övriga tillgångar	37 868	0,5	260 054	3,9
<b>Summa tillgångar</b>	<b>8 297 399</b>	<b>100,5</b>	<b>6 844 089</b>	<b>103,9</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	659	0,0	657	0,0
Övriga skulder	37 549	0,5	254 087	3,9
<b>Summa skulder</b>	<b>38 208</b>	<b>0,5</b>	<b>254 743</b>	<b>3,9</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>8 259 191</b>	<b>100,0</b>	<b>6 589 346</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

POSTER INOM LINJEN			
Utlånade finansiella instrument	44 840	0,5	170 197
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	49 357	0,6	182 569
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	1 373	0,0	1 183

1) Likvida medel 1 373 tSEK

XACT OMXS30 ESG (UCITS ETF), forts.

**Fondens innehav av finansiella instrument****Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 99,8**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>SVERIGE</b>			
ABB	739 728	313 719	3,8
Alfa Laval	658 416	258 757	3,1
Assa Abloy B	1 681 152	435 418	5,3
AstraZeneca	255 024	394 777	4,8
Atlas Copco A	5 349 696	831 343	10,1
Atlas Copco B	2 486 880	333 864	4,0
Autoliv SDB	57 024	52 268	0,6
Boliden	435 600	135 711	1,6
Electrolux	438 240	64 509	0,8
Ericsson B	4 911 456	286 878	3,5
Essity B	1 021 680	293 324	3,6
Getinge B	404 976	76 520	0,9
Handelsbanken A	3 098 832	279 948	3,4
Hennes & Mauritz B	2 286 768	423 464	5,1
Hexagon B	4 135 296	548 961	6,6
Investor B	2 902 944	626 020	7,6
Kinnevik B	387 024	57 821	0,7
NIBE Industrier B	2 840 640	290 882	3,5
Nordea Bank	2 287 824	268 362	3,2
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden B	1 982 112	8 193	0,1
Sandvik	1 998 480	420 080	5,1
SCA B	1 016 400	139 704	1,7
SEB A	3 433 056	409 049	5,0
Sinch	1 339 536	32 618	0,4
SKF B	678 480	127 283	1,5
Swedbank A	1 803 648	327 993	4,0
Tele2 B	1 068 144	95 193	1,2
Telia	6 265 248	148 173	1,8
Volvo B	2 530 704	564 347	6,8
		<b>8 245 180</b>	<b>99,8</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>8 245 180</b>	<b>99,8</b>

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 0,0**

	Underliggande exponering tSEK	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
OMX Stockholm 30 ESG Jul 2023	13 022	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>8 245 180</b>	<b>99,8</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		14 011	0,2
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>8 259 191</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

**Sammanställning, företags- och koncernexponeringar\***

Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Atlas Copco	14,1

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehåller mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

**Uppgifter om fondens värdepapperslån**

**Volym utlånade värdepapper, tSEK 44 840**

**Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar 0,5**

**De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:**

Brittiska staten	10 250
Amerikanska staten	8 808
Franska staten	5 753
Liberty Broadband	699
Hsbc Holdings	605
Nippon Paint Holdings	413
Tyska staten	323
Denso	298
Gartner	295
PPL	286

**De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:**

UBS AG London Branch	16 581
Barclays Capital Securities	11 766
SEB	11 353
Morgan Stanley & Co. International	4 593
Goldman Sachs International	3 740
Svenska Handelsbanken	1 108
Merrill Lynch International	216

**Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:**

Obligationer och andra räntebärande instrument	25 487
Aktier	23 870

**49 357**

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	15
En till tre månader	0
Tre månader till ett år	2 283
Mer än ett år	23 189
Obestämld löptid	23 870
	<b>49 357</b>

**Motparternas hemvist, tSEK**

Storbritannien	36 896
Sverige	12 461
	<b>49 357</b>

**Säkerheternas valuta, tSEK**

AUD	315
CHF	16
DKK	0
EUR	6 679
GBP	12 306
HKD	0
JPY	5 601
SEK	56
USD	24 384
	<b>49 357</b>

**Avveckling och clearing, tSEK**

Tredje part	49 357
	<b>49 357</b>

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämmd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 1 348 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- SEB
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende garanterad, godkänd, emitterad eller understödd av Nasdaq OMX Group, Inc. ("OMX") och OMX lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av OMX Stockholm 30 ESG Responsible Index kan ge upphov till eller med avseende på OMX Stockholm 30 ESG Responsible Index på värdet av nämnda index vid viss tidpunkt. OMX skall i intet fall vara ansvarig för fel i och skall inte heller vara skyldig att meddela eller offentliggöra eventuella fel i detta index. OMX och OMX Stockholm 30 ESG Responsible Index är varumärken tillhörande OMX och används enligt licens från OMX.

Förvaltare: ANDERS DOLATA

BASVALUTA

Fondens  
basvaluta

# XACT Svenska Småbolag (UCITS ETF)

*Börshandlad indexfond, noterad på Stockholmsbörsen*

## Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet Solactive ISS ESG Screened Sweden Small Cap Tradable Index (100%) så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltat. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,5%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet är återinvesterande, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet, justerat för skatt. Indexet syftar till att återspegla de omkring 100 mest likvida aktierna på den svenska småbolagsmarknaden exklusive de bolag som inte uppfyller index hållbarhetskrav. Det index som fonden följer innefattar hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven innefattar att index väljer bort bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer samt bolag som är verksamma inom kontroversiella sektorer såsom förbjudna vapen, kärnvapen, krigsmaterial, tobak, alkohol, cannabis, kommersiell spelverksamhet och pornografi. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet och fondens index hänvisas till informationsbroschüren.

## Portföljen

Fonden steg med 4,7% under första halvåret 2023\*. Portföljen förvaltas genom fysisk replikering och består av samtliga aktier som ingår i indexet Solactive ISS ESG Sweden Small Cap Tradable Index. Index viktades om i slutet av maj då Biotage, Camurus, Embracer, HMS Network och NCAB Group tillkom. Bilia, Byggmax, CTEK, G5 Entertainment, Lifco och Neobo fastigheter utgjck. Vid halvårsskiftet var de tre största innehaven Indutrade, SKF och Trelleborg.

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 5 av 7, dvs. en medelhög riskklass. Det betyder att fonden har medelhög risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av mindre och medelstora företag i Sverige. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker i företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Fondens placeringsinriktning innebär exponering mot mindre bolag där likviditeten ofta är lägre, och variationen i likviditet generellt bedöms vara förhöjd jämfört med aktiemarknaden i stort. Detta kan komma att påverka fondens möjligheter att hantera stora utflöden till en begränsad kostnad. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (välja bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna

möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

• Högsta hävstång under räkenskapsåret	0,3%
• Lägsta hävstång under räkenskapsåret	0,0%
• Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret	0,0%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns

XACT Svenska Småbolag (UCITS ETF), forts.

uppgifter om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK	223,67	213,63	315,06	237,79	195,91	139,54	139,40	128,90	-	-
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	692	459	-845	-455	-502	0	-184	1 595	-	-
Fondförmögenhet, mnSEK	1 979	1 250	1 166	1 712	1 832	1 751	1 749	1 772	-	-
Antal andelar, tusental	8 850	5 850	3 700	7 200	9 350	12 550	12 550	13 750	-	-
Total avkastning i %	4,7	-32,2	32,5	21,4	40,4	0,1	8,1	28,9	-	-
Jämförelseindex inklusive utdelning i %	4,8	-32,1	32,8	21,7	41,1	-1,0	8,8	32,3	-	-
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	0,0	0,0	0,1	1,3	1,4	0,9	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	-10,2	-5,2	26,8	30,5	18,5	4,0	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	-10,0	-5,0	27,1	31,0	18,2	3,8	-	-	-	-
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	8,5	8,9	19,6	-	-	-	-	-	-	-
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	8,7	8,9	19,7	-	-	-	-	-	-	-

Jämförelseindex: Solactive ISS ESG Screened Sweden Small Cap Tradable Index

T o m 2018-03-31: CSRSE Carnegie Small Cap Return Index Gross

T o m 2019-09-30: CSXSE100

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevant branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagt. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,30
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,30
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,34
Transaktionskostnader, tSEK	104
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	1,1
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	1,6
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått \*

Total risk %	26,8	Aktiv avkastning %	-0,2
Total risk i index %	26,8	Informationskvot	Negativ
Jämförelseindex	Solactive ISS ESG	Sharpekvot	-0,4
	Screened Sweden Small Cap Tradable Index	Sharpekvot i index	-0,4

\* Riskmåttarna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

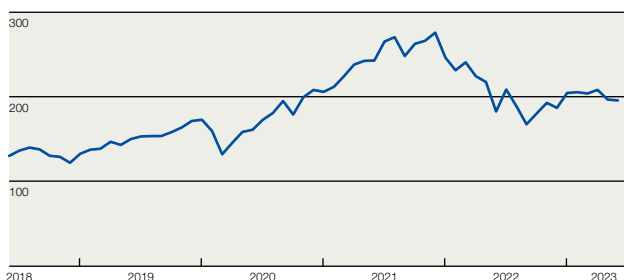
De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	1 979 511	100,0	1 249 768	100,0
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>1 979 511</b>	<b>100,0</b>	<b>1 249 768</b>	<b>100,0</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	-30	0,0	-628	-0,1
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	518	0,0	952	0,1
Övriga tillgångar	33 550	1,7	21 363	1,7
<b>Summa tillgångar</b>	<b>2 013 549</b>	<b>101,7</b>	<b>1 271 455</b>	<b>101,7</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	520	0,0	392	0,0
Övriga skulder	33 551	1,7	21 338	1,7
<b>Summa skulder</b>	<b>34 071</b>	<b>1,7</b>	<b>21 730</b>	<b>1,7</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>1 979 478</b>	<b>100,0</b>	<b>1 249 725</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

## Fondens utveckling \*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

## POSTER INOM LINJEN

Utlånade finansiella instrument	165 231	8,3	179 434	14,4
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	187 499	9,5	190 648	15,3

## Fondens innehav av finansiella instrument

### Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 100,0

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>SVERIGE</b>			
AarhusKarlskamm	191 337	38 803	2,0
AddLife	116 820	14 217	0,7
Addtech B	260 721	61 217	3,1
AFRY	100 182	15 949	0,8
Alleima	218 772	10 733	0,5
Arjo B	221 427	8 653	0,4
Atrium Ljungberg	48 498	9 050	0,5
Avanza Bank Holding	129 033	28 323	1,4
Axfood	114 696	26 174	1,3
Beijer Ref B	394 533	54 288	2,7
BHG Group	141 246	2 120	0,1
BICO B	55 578	2 168	0,1
Billerud	243 375	19 947	1,0
BioArctic B	38 940	10 981	0,6
Biotage	71 508	9 596	0,5
Bonava B	85 491	1 551	0,1
Boozt	60 003	7 230	0,4
Bravida	218 949	22 683	1,1
Bufab	27 966	10 314	0,5
Bure Equity	57 525	14 416	0,7
Calliditas Therapeutics	42 126	3 652	0,2
Camurus	31 506	8 778	0,4
Castellum	403 383	41 528	2,1
Catena	36 108	14 255	0,7
Cibus Nordic Real Estate	51 684	5 419	0,3
Cint Group	192 045	1 678	0,1
Clas Ohlson B	41 418	3 351	0,2
Corem Property B	682 335	3 456	0,2
Diös Fastigheter	86 553	5 959	0,3
Dometic Group	322 140	22 872	1,2
Electrolux	235 233	34 626	1,7
Electrolux Professional	247 446	14 476	0,7
Elekta B	393 117	32 762	1,7
Embracer Group B	786 588	21 206	1,1
Fabege	270 810	21 004	1,1
Fastighets AB Balder	697 203	27 442	1,4
Fingerprint Cards B	425 154	781	0,0
Fortnox	524 982	33 431	1,7
Getinge B	237 180	44 815	2,3
Gränges	113 103	11 638	0,6
Hansa Medical	52 746	2 292	0,1
Hennet Group	80 181	15 138	0,8
Hexatronix Group	174 699	14 042	0,7
Hexpol B	280 722	32 087	1,6
HMS Network	29 736	15 701	0,8

XACT Svenska Småbolag (UCITS ETF), forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
Holmen B1	101 421	39 290	2,0
Hufvudstaden	113 634	14 557	0,7
Husqvarna B	474 006	46 282	2,3
Indutrade	291 342	70 767	3,6
Instalco	227 976	12 277	0,6
Intrum Justitia	83 190	5 822	0,3
Inwido	55 401	5 438	0,3
JM	49 029	7 045	0,4
Kinnevik B	268 863	40 168	2,0
Lagercrantz Group	201 249	27 974	1,4
Lindab International	80 358	12 327	0,6
Loomis	77 880	24 501	1,2
Medicover B	72 216	11 822	0,6
Mips	27 966	14 939	0,8
Modern Times Group MTG B	99 120	6 815	0,3
Munters Group B	197 355	24 137	1,2
Mycronic	77 703	20 747	1,0
NCAB Group	150 627	12 660	0,6
NCC B	78 411	7 390	0,4
New Wave B	94 518	8 964	0,5
Nolato B	208 860	10 589	0,5
Nordnet	148 680	21 455	1,1
Note	20 355	4 621	0,2
NP3 Fastigheter	30 090	4 902	0,2
Nyfosa	159 123	9 484	0,5
Oncopeptides	63 720	553	0,0
Orrön Energy	205 674	2 331	0,1
OX2	113 811	8 297	0,4
Pandox B	97 527	12 249	0,6
Peab B	172 752	7 401	0,4
Ratos B	221 781	6 702	0,3
Sagax B	206 736	44 035	2,2
Samhällsbyggnadsbolaget i Norden B	1 211 742	5 009	0,3
Scandic Hotels Group	194 346	8 495	0,4
Sdiptech	32 745	8 749	0,4
Sectra	141 777	25 647	1,3
Securitas	507 105	44 859	2,3
Sinch	676 671	16 477	0,8
Skanska B	364 266	55 059	2,8
SKF B	394 887	74 081	3,7
SSAB B	934 206	69 785	3,5
Stillfront Group	489 759	8 830	0,4
Storskogen Group B	1 342 368	13 222	0,7
Sweco B	197 355	23 426	1,2
Swedish Orphan Biovitrum	204 612	43 050	2,2
Tele2 B	580 560	51 740	2,6
Thule Group	113 988	36 146	1,8
Trelleborg B	245 499	64 173	3,2
Truecaller B	123 192	3 645	0,2
Viaplay Group B	84 783	5 240	0,3
Vitec Software Group	33 099	17 940	0,9
Vitrolife	83 721	17 531	0,9
VNV Global	112 218	2 244	0,1
Wallenstam B	386 745	14 124	0,7
Willborgs Fastigheter	290 988	22 697	1,1
<b>Noterade aktier</b>		<b>1 979 511</b>	<b>100,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>1 979 511</b>	<b>100,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		-32	0,0
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>1 979 478</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

#### Uppgifter om fondens värdepapperslån

**Volym utlånade värdepapper, tSEK** 165 231

**Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar** 8,3

#### De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, tSEK:

Amerikanska staten	69 757
Brittiska staten	19 676
Franska staten	4 341
Österrikiska staten	4 300
Tyska staten	2 458
Rio Tinto	1 954
AstraZeneca	1 878
Shell	1 817
Whitebread	1 768
Barclays	1 753

#### De största motparterna för värdepapperslån, tSEK:

UBS AG London Branch	54 123
Goldman Sachs International	34 593
BNP Paribas Arbitrage SNC	34 413
Svenska Handelsbanken	28 230
Barclays Capital Securities	20 376
J.P. Morgan Securities	9 994
HSBC Bank	2 949
Citigroup Global Markets	2 822

#### Typ av och kvalitet på säkerheten, tSEK:

Obligationer och andra räntebärande instrument	101 945
Aktier	85 554
<b>Totalt</b>	<b>187 499</b>

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

#### Säkerheternas löptidsprofil, tSEK:

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	896
En till tre månader	603
Tre månader till ett år	760
Mer än ett år	99 686
Obestämd löptid	85 554
<b>Totalt</b>	<b>187 499</b>

#### Motparternas hemvist, tSEK

Frankrike	34 413
Storbritannien	124 856
Sverige	28 230
<b>Totalt</b>	<b>187 499</b>

#### Säkerheternas valuta, tSEK

AUD	587
CHF	513
DKK	851
EUR	16 413
GBP	44 161
HKD	1 034
JPY	30 496
NZD	30
SEK	2 138
SGD	23
USD	91 253
<b>Totalt</b>	<b>187 499</b>

#### Avveckling och clearing, tSEK

Tredje part	187 499
<b>Totalt</b>	<b>187 499</b>

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

#### Uppgifter om avkastning och kostnad:

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 22 621 tSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

#### Motparter för värdepappersutlåning under året:

- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Citigroup Global Markets
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende sponsrad, garanterad, godkänd, emitterad, marknadsförd, såld eller understödd på något annat sätt av Solactive AG (Solactive) och Solactive lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av dess index, index varumärke eller indexnivå kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. Indexet beräknas och publiceras av Solactive. Solactive gör sitt bästa för att se till att indexet beräknas korrekt. Oavsett skyldigheter gentemot fondens emittent har Solactive ingen skyldighet att påpeka fel i indexet till tredje part, inklusive men inte begränsat till investerare i fonden och/eller finansiella intermedärer i fonden. Varken offentliggörande av index eller licensiering av index eller index varumärke för användning i samband med fonden utgör någon rekommendation från Solactive att investera kapital i fonden, ej heller utgör det inte på något sätt en försäkring eller åsikt från Solactive avseende eventuella investeringar i denna fond.



# XACT Sverige (UCITS ETF)

Börshandlad indexfond, noterad på Stockholmsbörsen

## Placeringsinriktning

Fonden är en börshandlad indexfond och har som mål att följa utvecklingen i indexet SIX Sweden ESG Selection Index så nära som möjligt. Fonden är passivt förvaltd. Fondens avkastning bestäms av hur de aktier som fonden placerar i ökar eller minskar i värde. Indexet efterbildas genom optimerad (sample based) fysisk replikering, vilket innebär att fonden placerar direkt i flertalet aktier som ingår i indexet. Aktiv risk (eng. tracking error) under normala marknadsförhållanden förväntas bli mindre än 0,2%. Förvaltningsavgift samt kundflöden, indexrebalansering och företagshändelser ger samtliga upphov till transaktionskostnader för fonden, vilket inte finns i index. Dessa är de faktorer som främst påverkar fondens möjligheter att efterbilda index. Indexet är återinvesterande, d.v.s. utdelningar som betalas ut för aktier som ingår i indexet återinvesteras i indexet. Indexet består av ett urval av de mest handlade aktierna på Nasdaq Stockholm Stock Exchange vilka möter hållbarhetskraven i index. Det index som fonden följer innefattar hållbarhetskrav. Fonden placerar i aktier som ingår i detta index. Det index som fonden följer innefattar hållbarhetskrav. Hållbarhetskraven innefattar att index väljer bort bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer samt bolag som är verksamma inom kontroversiella sektorer såsom förbudna vapen, kärnvapen, krigsmaterial, tobak, alkohol, cannabis, kommersiell spelverksamhet och pornografi. Hållbarhetskraven innefattar även att index väljer in bolag med höga hållbarhetsbetyg. Minst 50% av indexbolagen, mätt i totalt marknadsvärde av index, ska vara bedömda som ledare inom hållbarhet. Fonden placerar i aktier som ingår i detta index. Fonden får placera i derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning. Användningen av derivatinstrument är dock inte av sådan karaktär att den påverkar fondens risknivå annat än marginellt. För mer information om hållbarhetsarbetet och fondens index hänvisas till informationsbroschyren.

## Portföljen

Fonden steg med 11,7% under första halvåret 2023\*.

Portföljen består av samtliga aktier som ingår i indexet SIX Sweden ESG Selection Index GI. Vid halvårsskiftet var fondens största innehav Atlas Copco, Investor och Volvo AB. Största sektorvikter var industrivaror och tjänster, finans samt sällanköpsvaror och tjänster. Hållbarhetskraven i index innebär dels att bolag med höga hållbarhetsbetyg ingår (väljs in), dels att bolag som är involverade i kontroversiella verksamheter inte får ingå (väljs bort).

\* För jämförelseindex se fondens fondfakta.

## Väsentliga risker

Fonden är en aktiefond som är riskklassificerad med 5 av 7, dvs. en medelhög riskklass. Det betyder att fonden har medelhög risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Fondens placeringar är koncentrerade geografiskt till aktier utgivna av företag i Sverige. Detta innebär att risken i fonden normalt är högre än en investering i en diversifierad global aktiefond som fördelar sina investeringar över flera regioner. Fondens placeringar sker i företag i flera sektorer eller branscher vilket minskar risken i fonden. Fonden får investera i derivat för att effektivisera förvaltningen eller minska riskerna i fondens placeringar. Fonden får placera i derivat och gör det i syfte att skydda värdet på fondens underliggande tillgångar, upprätthålla önskad risknivå i fondportföljen eller för att minimera kostnaderna för förvaltningen. Omfattningen av handeln är i förekommande fall begränsad och förväntas ha marginell inverkan på fondens riskprofil.

Hållbarhetsrisken, det vill säga en miljörelaterad, social eller bolagsstyrningsrelaterad händelse eller omständighet som skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på ett bolags värde, hanteras primärt genom exkludering (väljs bort) samt påverkan i form av dialog och aktiv ägarstyrning.

## Handel med derivatinstrument m.m

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i

fondens placeringsinriktning. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att låna ut värdepapper. Under 2023 har fonden utnyttjat denna möjlighet. Fonden har möjlighet att använda andra tekniker och instrument. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

- Högsta hävstång under räkenskapsåret 0,5%
- Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0,0%
- Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0,1%

## Information

Sedan förändringen av skatteregler för svenska fonder (2012) och med anledning av utvecklingen av praxis på skatteområdet, råder osäkerhet om beskattningen av utländska utdelningar. För ytterligare information, se under allmänna sidor i slutet av fondrapporten.

## Aktieägarengagemang

Utifrån Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar samt fondbolagets Röstningspolicy, bedrivs röstning på bolagsstämmor, valberedningsarbete samt dialog med portföljbolagen i egen regi eller i samarbete med andra. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer för valberedningsarbete. Det är vår uppfattning att detta arbete leder till bättre styrning och minskade hållbarhetsrisker i portföljbolagen, vilket i sin tur leder till en positiv värdeutveckling.

Fondbolaget säkerställer att relevant information finns tillgänglig som underlag till analys och röstningsbeslut. Det görs genom analys från röstningsrådgivare men även genom marknadsinformation, tredjepartsanalys eller kontakt med bolaget. Fondbolaget fattar sedan självständiga beslut i de frågor där omröstning eller annat beslutsfattande ska ske.

Fondbolaget röstar som huvudprincip på stämmor där fonderna äger minst 0,5 % av rösterna, där bolag utgör väsentliga innehav i resp. fond, där fondbolaget bedömer att det kräver en särskild påverkansinsats i enlighet med fondbolagets uppsatta hållbarhetsmål och åtaganden, bolag med vilka fondbolaget för dialog där föremålet för dialogen är uppe för beslut på stämman, bolagsstämmor där relevanta hållbarhetsfrågor är uppe för beslut samt i övrigt på stämmor som behandlar principiella eller kontroversiella frågor. Eventuella aktielån återkallas normalt inför bolagsstämman för att röstning ska kunna ske för samtliga aktier men om det anses mer gynnsamt för andelsägarna och inte har väsentlig påverkan på ägarinflytandet, kan aktielån i vissa fall ligga kvar över bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder deltar normalt i valberedningar där vi har tillräckligt stort ägande för att erbjudas en plats. Utanför Norden är det dock ovanligt med valberedningar och styrelsesammansättningen kan endast påverkas genom röstning på bolagsstämman.

Handelsbanken Fonder bedriver som en del i sitt aktieägarengagemang påverkansdialoger med bolag i syfte att uppmuntra företagen att förbättra sitt hållbarhetsarbete, och med företag som inte bedöms leva upp till de internationella normer och konventioner som fondbolaget värnar om.

Påverkansarbete utförs framför allt genom; direkta dialoger mellan Handelsbanken Fonder och bolagen, gemensamma dialoger tillsammans med andra investerare samt samarbeten och initiativ med fokus på specifika hållbarhetsfrågor.

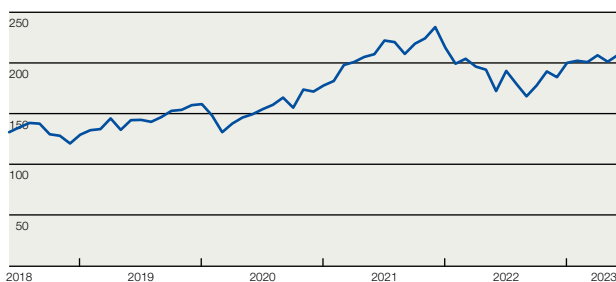
Det har i samband med fondens placeringar inte uppkommit några intressekonflikter mellan Fondbolaget och portföljbolagen. I Fondbolagets

XACT Sverige (UCITS ETF), forts.

Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns uppgeför om hur Fondbolaget i allmänhet hanterar intressekonflikter som kan uppstå i samband med fondens placeringar.

Läs mer om hur Handelsbanken Fonder agerar i ägarfrågor och om fondbolagets riktlinjer för ansvarsfulla investeringar i bolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar, fondbolagets Röstningspolicy samt i Riktlinjer för valberedningsarbetet som återfinns under handelsbankenfonder.se/policy och riktlinjer. I de hållbarhetsrelaterade upplysningarna som utgör bilaga till fondernas informationsbroschyr respektive årsberättelse, kan du läsa mer om det påverkansarbete i form av dialoger och ägarstyrning som fondbolaget för fondens räkning bedriver.

## Fondens utveckling\*



\* Utvecklingen visas i fondens basvaluta.

## Fondfakta - historik

	1/1-30/6 2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Andelsvärde, SEK	553,13	513,42	685,53	517,64	498,09	392,57	425,90	403,55	383,81	378,10
Fondens totala nettoflöde, mnSEK	655	225	367	-1 835	-200	197	24	-642	595	-339
Fondförmögenhet, mnSEK	2 171	1 425	1 645	971	2 814	2 385	2 406	2 260	2 811	2 240
Antal andelar, tusental	3 925	2 775	2 400	1 875	5 650	6 075	5 650	5 600	7 325	5 925
Total avkastning i %	11,7	-20,9	36,9	8,4	31,2	-4,5	9,9	9,0	5,9	14,7
Jämförelseindex inklusive utdelning i %	11,9	-20,9	37,2	8,5	31,5	-4,3	10,0	9,2	6,1	15,0
Aktiv risk 2 år, % (Tracking error)	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1	0,0	0,1	0,0	0,0
Genomsnittlig årsavkastning 2 år, %	-0,2	4,0	21,9	19,3	12,0	2,5	9,5	7,4	10,2	19,9
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	0,0	4,2	22,1	19,5	12,2	2,6	9,6	7,6	10,5	20,2
Genomsnittlig årsavkastning 5 år, %	9,5	8,0	15,4	10,2	9,7	6,8	12,7	14,0	8,9	12,7
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	9,7	8,2	15,6	10,4	9,9	7,0	13,0	14,3	9,2	13,0
Genomsnittlig årsavkastning 10 år, %	10,7	10,4	14,7	9,5	11,2	12,6	7,8	6,3	7,8	10,5
Motsvarande för jämförelseindex inklusive utdelning, %	10,9	10,6	14,9	9,8	11,5	12,8	8,0	6,6	8,1	10,8
Utdelning per andel, SEK	20,54	27,43	20,70	19,90	15,27	15,71	18,27	13,31	17,65	15,10

Jämförelseindex: SIX Sweden ESG Selection Index GI

T o m 2018-10-09: OMXSB™ Gross Index

Fondens jämförelsenorm utgör en relevant referens i förhållande till fondens placeringsriktning, tillgångslag, marknader och i de fall det är relevantt branscher. Om fonden lämnar utdelning är utvecklingen beräknad med utdelningen återlagd.

För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

## Fondfakta - kostnader

Max tillåten förvaltningskostnad i % enligt fondbestämmelser	0,15
Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet	0,15
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, i %	0,17
Transaktionskostnader, tSEK	69
Transaktionskostnader i % av omsättningen	0,00

## Fondfakta - övriga nyckeltal

Omsättningshastighet, ggr	0,4
Andel av omsättning som skett genom närstående vp-institut, %	7,8
Andel av oms. som skett mellan fonder förvaltade av Handelsbanken Fonder AB, %	0,0

## Risk- och avkastningsmått\*

Total risk %	20,7	Informationskvot	Negativ
Total risk i index %	20,7	Sharpekvot	0,0
Jämförelseindex	SIX Sweden ESG	Sharpekvot i index	0,0
	Selection Index GI		
Aktiv avkastning %	-0,2		

\* Risksiffrorna är baserade på två års historisk månadsavkastning. För definitioner, se under allmänna sidor i slutet av den samlade fondrapporten.

De sammanlagda exponeringarna i fonden beräknas enligt åtagandemetoden

## Balansräkning, tSEK

	30 juni 2023	% av fondförm.	31 dec. 2022	% av fondförm.
<b>TILLGÅNGAR</b>				
Överlåtbara värdepapper	2 168 875	99,9	1 423 443	99,9
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> <sup>Not 1)</sup>	<b>2 168 875</b>	<b>99,9</b>	<b>1 423 443</b>	<b>99,9</b>
Bankmedel och övriga likvida medel	435	0,0	55	0,0
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	2 018	0,1	1 421	0,1
Övriga tillgångar	-	-	25 671	1,8
<b>Summa tillgångar</b>	<b>2 171 328</b>	<b>100,0</b>	<b>1 450 590</b>	<b>101,8</b>
<b>SKULDER</b>				
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	287	0,0	221	0,0
Övriga skulder	-	-	25 638	1,8
<b>Summa skulder</b>	<b>287</b>	<b>0,0</b>	<b>25 859</b>	<b>1,8</b>
<b>Fondförmögenhet</b>	<b>2 171 041</b>	<b>100,0</b>	<b>1 424 731</b>	<b>100,0</b>

Not 1) till balansräkning

POSTER INOM LINJEN			
Utlånade finansiella instrument	83 831	3,9	89 371
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument	93 954	4,3	96 032
Ställda säkerheter för övriga derivatinstrument <sup>1)</sup>	188	0,0	-

1) Likvida medel 188 tSEK

## Fondens innehav av finansiella instrument

Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES **99,9**

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde tSEK	% av fondförm.
<b>NOTERADE AKTIER</b>			
<b>SVERIGE</b>			
AarhusKarlshamn	82 111	16 652	0,8
ABB	147 423	62 522	2,9
AFRY	34 540	5 499	0,3
Alfa Laval	130 781	51 397	2,4
Arjo B	80 384	3 141	0,1
Assa Abloy B	333 939	86 490	4,0
AstraZeneca	50 711	78 501	3,6
Atlas Copco A	1 062 576	165 124	7,6
Atlas Copco B	493 922	66 309	3,1
Autoliv SDB	11 618	10 649	0,5
Axfood	68 609	15 657	0,7
BICO B	21 823	851	0,0
Billerd	78 971	6 472	0,3
Boliden	86 507	26 951	1,2
Castellum	161 396	16 616	0,8
Catena	15 857	6 260	0,3
Domestic Group	101 108	7 179	0,3
Electrolux	86 978	12 803	0,6
Elekta B	116 651	9 722	0,4
Epiroc A	260 777	53 172	2,4
Epiroc B	123 402	21 509	1,0
EQT	375 230	77 823	3,6
Ericsson B	972 301	56 792	2,6
Essity B	203 001	58 282	2,7
Fabege	104 719	8 122	0,4
Fingerprint Cards B	131 880	242	0,0
Getinge B	80 384	15 189	0,7
Handelsbanken A	615 440	55 599	2,6
Handelsbanken B	11 147	1 199	0,1
Hennes & Mauritz B	462 208	85 592	3,9
Holmen B1	37 052	14 354	0,7
Hufvudstaden	64 213	8 226	0,4
Husqvarna B	147 580	14 410	0,7
Industrivärden A	82 425	24 629	1,1
Industrivärden C	54 322	16 144	0,7
Investor A	394 541	85 102	3,9
Investor B	576 661	124 357	5,7
JM	20 410	2 933	0,1
Kinnevik B	76 930	11 493	0,5
Lundin Mining	18 840	1 582	0,1

XACT Sverige (UCITS ETF), forts.

	Antal/Nom. bel. tusental	Marknadsvärde TSEK	% av fondförm.
Millicom International Cellular SDB	49 769	8 204	0,4
Mips	8 321	4 445	0,2
Mycronic	30 929	8 258	0,4
NIBE Industrier B	564 258	57 780	2,7
Nordea Bank	449 962	52 781	2,4
Orrön Energy	90 432	1 025	0,0
Pandox B	34 383	4 319	0,2
Ratos B	76 459	2 311	0,1
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden B	393 756	1 628	0,1
Sandvik	397 053	83 461	3,8
SCA B	201 902	27 751	1,3
SEB A	681 851	81 243	3,7
Securitas	173 014	15 305	0,7
Sinch	265 801	6 472	0,3
Skanska B	126 699	19 151	0,9
SKF B	134 863	25 300	1,2
SSAB A	96 241	7 374	0,3
SSAB B	229 691	17 158	0,8
Stora Enso R	16 328	2 043	0,1
Swedbank A	358 274	65 152	3,0
Swedish Orphan Biovitrum	98 125	20 646	1,0
Tele2 B	212 107	18 903	0,9
Telia	1 244 382	29 430	1,4
Thule Group	33 127	10 505	0,5
Trelleborg B	71 749	18 755	0,9
Viaplay Group B	24 649	1 523	0,1
Volvo A	140 829	32 334	1,5
Volvo B	502 714	112 105	5,2
Volvo Car B	942 942	40 377	1,9
Wihlborgs Fastigheter	97 340	7 593	0,3
		<b>2 168 875</b>	<b>99,9</b>
<b>Noterade aktier</b>		<b>2 168 875</b>	<b>99,9</b>

**Övriga finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES 0,0**

	Underliggande exponering TSEK	Marknadsvärde TSEK	% av fondförm.
<b>AKTIEINDEXTERMINER</b>			
OMX Stockholm 30 ESG Jul 2023	1 986	0	0,0
<b>Aktieindexterminer</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
<b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b>		<b>2 168 875</b>	<b>99,9</b>
<b>Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde</b>		<b>0</b>	<b>0,0</b>
Netto, övriga tillgångar och skulder		2 166	0,1
<b>Total summa fondförmögenhet</b>		<b>2 171 041</b>	<b>100,0</b>

I tabellerna är siffrorna avrundade till närmsta tusental respektive första decimal, vilket gör att en summering av kolumnerna kan ge belopp som avviker från den angivna slutsumman.

### Sammanställning, företags- och koncernexponeringar\*

Företag/koncern	% av fondförmögenheten	Företag/koncern	% av fondförmögenheten
Atlas Copco	10,7	Svenska Handelsbanken	2,6
Investor	9,6	Industrivärden	1,9
Volvo	6,7	SSAB	1,1
Epiroc	3,4		

\* I tabellen anges den sammanlagda procentuella andelen av förmögenheten per företag/koncern, i de fall fonden innehåller mer än en typ av värdepapper utgivna av samma företag/koncern.

### Uppgifter om fondens värdepapperslån

**Volym utlånade värdepapper, TSEK 83 831**

**Volym utlånade värdepapper i % av totala utlåningsbara tillgångar 3,9**

**De tio största utfärdarna av säkerheter för värdepapperslån per emittent, TSEK:**

Amerikanska staten	45 049
Brittiska staten	2 327
Franska staten	2 054
Rio Tinto	1 480
AstraZeneca	1 431
BP	1 317
Unilever	1 168
Seven & I Holdings	1 168
Isui House	909
Barclays	892

**De största motparterna för värdepapperslån, TSEK:**

Goldman Sachs International	37 968
Barclays Capital Securities	14 923
Svenska Handelsbanken	13 504
BNP Paribas Arbitrage SNC	11 886
J.P. Morgan Securities	7 113
Merrill Lynch International	3 921
UBS AG London Branch	2 983
Morgan Stanley & Co. International	1 656

**Typ av och kvalitet på säkerheten, TSEK:**

Obligationer och andra räntebärande instrument	50 417
Aktier	43 537
	<b>93 954</b>

Vi godtar statsobligationer och statsskuldväxlar med en rating om AA- från S&P eller Aa3 från Moody's eller högre utgivna av amerikanska staten, brittiska staten, stater inom eurozonen (Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna,

Portugal och Spanien) samt Australien, Kanada, Danmark, Japan, Nya Zeeland, Norge, Sverige och Schweiz. Som säkerheter godtar vi vidare aktier i stora och välkända index.

**Säkerheternas löptidsprofil, TSEK:**

Mindre än en dag	-
En dag till en vecka	-
En vecka till en månad	107
En till tre månader	72
Tre månader till ett år	297
Mer än ett år	49 942
Obestämd löptid	43 537
	<b>93 954</b>

**Motparternas hemvist, TSEK**

Frankrike	11 886
Storbritannien	68 564
Sverige	13 504
	<b>93 954</b>

**Säkerheternas valuta, TSEK**

AUD	34
CHF	1 450
DKK	542
EUR	5 060
GBP	16 594
HKD	2 057
JPY	18 464
NZD	20
SEK	1 137
SGD	231
USD	48 364
	<b>93 954</b>

**Avveckling och clearing, TSEK**

Tredje part	93 954
	<b>93 954</b>

Löptidsprofilen för värdepapperslånen är obestämd men med möjlighet till omedelbar uppsägning.

De mottagna säkerheterna förvaras av J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. eller annat koncernbolag inom J.P. Morgankoncernen och återanvänds ej.

**Uppgifter om avkastning och kostnad:**

Värdepappersutlåningen har under året totalt genererat intäkter på 674 TSEK, varav 80% har tillfallit fonden och 20% J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. i dess egenskap av förmedlare av värdepapperslån.

**Motparter för värdepappersutlåning under året:**

- Barclays Capital Securities
- BNP Paribas Arbitrage SNC
- Goldman Sachs International
- HSBC Bank
- J.P. Morgan Securities
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley & Co Intl
- Svenska Handelsbanken
- UBS AG London Branch

Fonden är inte i något avseende garanterad, godkänd, emitterad eller understödd av SIX Financial Information AB ("SIX") och SIX lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av SIX Sweden ESG Selection Index kan ge upphov till eller med avseende på värdet av vid viss tidpunkt. SIX skall i intet fall vara ansvarig för fel i SIX Sweden ESG Selection Index. SIX skall ej heller vara skyldig att meddela eller offentliggöra eventuella fel i SIX Sweden ESG Selection Index. Alla rättigheter till varumärket SIX Sweden ESG Selection Index tillhör SIX och används enligt licens från SIX.



# Information från Handelsbanken Fonder AB

## Fondbolagets styrelse, verkställande direktör, revisorer och personal

Avser förhållandena per den 30 juni 2023

### Handelsbanken Fonder AB

---

#### Styrelse

MICHAEL GREEN, ordförande  
Bankdirektör, Svenska Handelsbanken AB (publ), chef Handelsbanken Sverige

MALIN BJÖRKMO  
egen konsultverksamhet avseende företagsstyrning och finansiella regelverk

HELEN FAST GILLSTEDT  
vd och ägare av rådgivnings- och ledarskapsföretag

LARS SEIZ  
strategisk förvaltningsrådgivare

ÅSA HOLTMAN ÖHMAN  
arbetstagarrepresentant Finansförbundet regionala klubb, CHK-klubben, Svenska Handelsbanken AB (publ)

Verkställande direktör  
MAGDALENA WAHLQVIST ALVESKOG

#### Fondbolagets revisorer

---

##### Vald av bolagsstämman

PRICEWATERHOUSECOOPERS AB, HELENA KAISER DE CAROLIS

#### Personal och organisation

---

Fondbolaget är ett helägt dotterbolag till Svenska Handelsbanken AB (publ).

Handelsbanken Fonder AB har följande ledande befattningshavare:

Verkställande direktör  
MAGDALENA WAHLQVIST ALVESKOG

Ställföreträdande Verkställande direktör  
EMMA VIOTTI

Riskchef  
FREDRIK ALHEDEN

Ägarstyrningsansvarig och styrelsesekreterare  
STAFFAN RINGVALL

Chefsjurist  
FREDRIK KÖSTER

Produktchef  
EMMA VIOTTI

Hållbarhetsansvarig  
AURORA SAMUELSSON

Compliancechef  
JENNY OGENFALK, tf

Chef Allokeringsförvaltning  
JOHANN GUGGI

Chef Passiv förvaltning  
CARL-HENRIK LINDBERG

Chef Aktiv förvaltning - Globala aktier  
LISA SYNNING

Chef Aktiv förvaltning - Svenska aktier  
CHRISTIAN BRUNLID

Chef Aktiv förvaltning - Nordiska aktier  
TORE MARKEN

Chef Aktiv förvaltning - Räntebärande  
KATARINA PASCHAL

Chef Exekvering  
RIKARD ERIKSSON

Postadress: 106 70 STOCKHOLM

Telefon: 08 - 701 10 00

# Information från Handelsbanken Fonder AB

## Ägarstyrning

Handelsbanken Fonder utövar en aktiv roll som ägare. Syftet är att medverka till att bolagen fattar beslut som leder till en hållbar och långsiktigt god värdeökning, som i sin tur gynnar våra andelsägare. Vi ser vår ägarroll utifrån ett långsiktigt perspektiv eftersom förändringar i företag ofta tar lång tid att genomföra. Som riktlinjer för vårt agerande finns en av Handelsbanken Fonders styrelse antagen Policy för Aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar. Vägledande för vårt arbete är även de principer som ställs upp i Svensk kod för bolagsstyrning. Fondbolagets arbete i valberedningar regleras även i Riktlinjer kring valberedningsarbete.

En mycket viktig kanal är de löpande kontakter som våra förvaltare har med de företag vi investerar eller avser att investera i. Det ger oss en väldigt bra möjlighet att framföra vår syn på den utveckling som företagen uppvisar. Vi lägger stor vikt vid god bolagsstyrning, hållbarhet och transparens hos bolagen vi investerar i.

Handelsbanken Fonder AB deltar i ett flertal valberedningar, där vi har ett tillräckligt stort ägande, och kan vara med för att kunna påverka förslaget till sammansättning av bolagsstyrelse mm. Styrelsen skall ha en bred och relevant kompetens och skilda perspektiv skall prägla dess sammansättning. Vi jobbar aktivt för en jämnare könsfördelning i styrelserna.

Fondbolaget har som ambition att rösta vid bolagsstämmor där vårt ägande är så stort att våra avlagda röster påverkar skeendet, normalt över ca 0,5 procent av rösterna. Varje år röstar vi på ett stort antal bolagsstämmor, i Norden men även i andra länder där vi har stort ägande. I vissa fall önskar företagen ha en dialog med aktieägarna innan ett förslag presenteras på en bolagsstämma för att förankra förslaget hos de största aktieägarna.

Handelsbanken Fonder AB deltar i sådana diskussioner i den mån vi kontaktas och framför då våra synpunkter som syftar till att åstadkomma ett gott utfall för andelsägarna.

Fondbolagets Policy för Aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar finns på hemsidan <https://www.handelsbanken.se/sv/om-oss/svenska-dotterbolag/handelsbanken-fonder/vart-arbete>

## Ansvarsfulla investeringar

Handelsbanken Fonders vision är att skapa finansiell avkastning och planetär avlastning genom hållbara investeringar. För att tydliggöra vägen dit har vi satt hållbarhetsmål som utgör den del av Handelsbankens utfästelser till FN:s principer för ansvarsfull bankverksamhet, PRB, som banken undertecknade 2019 samt fondbolagets åtagande enligt Net Zero Asset Managers initiative (NZAM-initiativet). Syftet med att sätta kvantitativa mål är att mäta våra resultat och ge våra intressenter möjlighet att följa vår utveckling. Målen omfattar alla våra fonder, och är satta inom två huvudområden.

Investeringsportföljer i linje med Parisavtalets klimatmål

- minska koldioxidintensiteten i våra fonder med 50 procent till 2030
- dubbla investeringar i klimatlösningar till 2030

Öka vårt bidrag till Agenda 2030

- öka andelen hållbara investeringar med 30 procent till 2025
- öka påverkansaktiviteter med positivt resultat årligen fram till 2025

Vägledande för Handelsbanken Fonders arbete inom hållbarhet är vår Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar. Policyn beskriver utgångspunkten för integreringen av hållbarhet, våra åtaganden avseende Global Compact, Principles for Responsible Investment (PRI) samt internationella normer och konventioner. Vidare beskriver den de metoder för hållbarhet som tillämpas i förvaltningen, välja bort, välja in och påverka samt principer för vårt ägarstyrningsarbete. Läs mer om detta under respektive fonds redovisning och i Fondbolagets Policy för aktieägarengagemang och ansvarsfulla investeringar som finns på hemsidan [handelsbanken.se](https://www.handelsbanken.se)

## Utländska källskatter

På grund av ändrade skatteregler 1 januari 2012 för svenska fonder och mot bakgrund av utvecklingen inom skatteområdet, råder osäkerhet om hur källskatten på utdelningar från aktier ska ske. Detta kan leda till både ökade intäkter och ökade kostnader avseende källskatt i fonder med utländska innehav. Intäkten eller kostnaden redovisas när den erhålls respektive betalas. Utdelningarna redovisas till det belopp som faktiskt erhålls men det kan inte uteslutas att dessa källskatteuttag kan komma att revideras, vilket skulle innebära att fonden i så fall kommer att belastas med ytterligare källskatt på tidigare erhållna utdelningar. Restitutioner (återbetalning av betald källskatt) redovisas när de erhålls. Ifråga om restitutioner för vissa fonder och från vissa länder, exempelvis Danmark och Finland, kan principen att restitutioner redovisas när de erhålls frångås om skatte- och redovisningsmässiga skäl härför föreligger.

## Mer information

Du finner fullständig informationsbroschyr med fondbestämmelser, faktablad och aktuell kursutveckling på [handelsbanken.se/fonder](https://www.handelsbanken.se/fonder). För mer information om köp och försäljning av andelar hänvisar vi till närmaste Handelsbankenkontor.

# Definitioner

## Fondfakta

**Andelsklasser** – En fond kan ha flera andelsklasser. Olika andelsklasser har olika villkor, exempelvis valuta, utdelning eller ej, förvaltningsavgift eller första lägsta insättningsbelopp. Fondförmögenheten är gemensam för andelsklasserna och uppgifterna avser därför fonden som helhet om inte annat uttryckligen anges. Andelarna inom respektive andelsklass är lika stora och medför lika rätt till den egendom som ingår i fonden. Utdelningen i en utdelande andelsklass påverkar relationen mellan värdet på andelar som är icke utdelande och värdet på andelar som är utdelande - värdet på de utdelande fondandelarna minskar i relation till utdelningens storlek.

**Andel av omsättningen som skett genom närstående värdepappersinstitut** – Den värdemässiga andel av fondens köp och försäljningar av finansiella instrument som skett genom närstående finansiella institut inom Handelsbankenskoncernen. Anges i procent av fondens totala omsättning.

**Andel av omsättningen som skett mellan fonder förvaldade av samma fondbolag** – Den värdemässiga andel av fondens köp och försäljningar av finansiella instrument som har skett för värdepappersfondens räkning från en annan fond förvaldat av samma fondbolag. Anges i procent av fondens totala omsättning.

**Andelsvärde** – Nettoandelsvärdet uttryckt som bokslutskursen respektive år.

**Andra tekniker och instrument** – Med tekniker och instrument för att effektivisera förvaltningen avses följande: Tekniker och instrument är hänförliga till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument som används på ett kostnadseffektivt sätt i syfte att minska risker eller kostnader eller för att öka avkastningen i fonden med en risknivå som är förenlig med fondens riskprofil och gällande riskspridningsregler. Exempel på tekniker och instrument är värdepappersutlåning, avtal om återköp av sålt värdepapper så kallade repor och omvända repor.

**Antal andelar** – Antal utelöpande andelar den sista bankdagen respektive år. Redovisas i tusen andelar.

**Duration** – Durationen för en fond är ett mått på hur känslig fonden är för ränteförändringar. Det kan förenklat beskrivas som ett vägt snitt av återstående löptid i fondens placeringar. Mäts i år eller i månader.

**Fondförmögenhet** – Fondens nettotillgångsvärde på bokslutsdagen respektive år.

**Fondens totala nettoflöde** – Insättningar minus uttag i fonden, inkluderar inte återinvesterade utdelningar och eventuella fusionsflöden. Uppgiften är ny för om helåret 2012.

**Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader** – Från 1 januari 2023 ersätter förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader årlig avgift. Kostnadsmåtten inkluderar förvaltningsavgift och avser löpande kostnader i fonden - dock ej transaktionskostnader på värdepapperstransaktioner, räntekostnader, transaktionsrelaterade skattekostnader och eventuella prestationsbaserad avgift.

Om fonden lånar ut värdepapper, erhåller fonden 80% av intäkten från värdepapperslånen och de återstående 20% tillfaller värdepapperslåneagenten. Intäktsdelningsavtalet ökar kostnaderna för fonden och ersättningen till värdepapperslåneagenten belastar kostnadsområdet förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader.

Måttet baseras på avgiftsuttaget ur fonden under perioden och uttrycks i procent av den genomsnittliga fondförmögenheten och beräknas på 12 månader.

För fonder som investerar i andra fonder görs ett tillägg för underliggande fonder senaste förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader efter avdrag för erhållna rabatter.

**Genomsnittlig fondförmögenhet** – Beräknas som medelvärdet av fondens nettotillgångsvärde under året (eller den del av året som fonden har funnits). Fondens nettotillgångsvärde beräknas på daglig basis.

**Genomsnittlig årsavkastning 2 år, 5 år respektive 10 år** – Fondens genomsnittliga effektiva årsavkastning under de senaste två, fem respektive tio åren.

**Index** – Det index som fonden använder som sitt jämförelseindex.

**Index inkl. utdelning** – Utvecklingen av fondens jämförelseindex under respektive år. Utvecklingen uttrycks i procent och är omräknad till valutans för respektive andelsklass, om indexet publiceras i någon främmande valuta. Tabellen visar index inklusive utdelning.

**Kostnad vid engångsinsättning 10 000 SEK** – Den totala kostnad som den andelsägare har belastats med, som vid årets början hade 10 000 SEK investerade i fonden och som behöll denna investering året ut. Beräknas endast för helår och för fonder och andels-

klasser som funnits under hela året. För fonder med basvaluta i EUR gäller motsvarande 1 000 EUR. För fonder med basvaluta i NOK gäller motsvarande 10 000 NOK.

**Kostnad för månadssparande 100 SEK** – Den totala kostnad som den andelsägare har belastats med, som satte in 100 kronor den första bankdagen respektive månad under året och som behöll denna investering året ut. Beräkns endast för helår och för fonder och andelsklasser som funnits under hela året. För fonder med basvaluta i EUR gäller motsvarande 10 EUR. För fonder med basvaluta i NOK gäller motsvarande 100 NOK.

**Omsättningshastighet (huvudregel)** – Fondens omsättningshastighet beräknad som kvoten mellan, å ena sidan, det lägsta av totalbeloppet för köpta eller sålda värdepapper under året, och, å andra sidan, den genomsnittliga fondförmögenheten under samma period. Från köpta eller sålda värdepapper exkluderas för aktiefonders del räntebärande värdepapper som vid förvärvstillfället hade en återstående löptid av högst 397 dagar. Omsättningshastigheten redovisas som omsatt antal gånger per år och beräknas på rullande 12 månader.

**Omsättningshastighet (hävstångsfonder)** – Om en fonden under perioden har handlat med derivatinstrument och en beräkning av omsättningshastigheten enligt huvudregeln medför att informationen om omsättningshastigheten blir missvisande, beräknas fondens omsättningshastighet även genom att summan av köpta och sålda finansiella instrument under perioden minskas med summan av tecknade och inlösta andelar i fonden. Detta belopp divideras med fondens genomsnittliga fondförmögenhet under perioden. Negativa omsättningshastighetstal uppkommer då summan av köpta och sålda fondbandelar överstiger summan av köpta och sålda derivat.

**Risk** – Beräkningen av fondens risk är gemensam för alla EU-medlemsländer. 1 står för lägst risk (små kursvägningar) och 7 för högst risk (risk för stora kursvägningar). Klassificeringen grundas på standardavvikelsen (volatiliteten) för fonden beräknad utifrån andelsvärdena under en femårsperiod. Om fem års historik saknas används standardavvikelsen på relevant jämförelseindex eller annan jämförelsenorm. Risken beskrivs främst marknadsrisken och valutarisken.

**Total avkastning** – Redovisar hur värdet av en andel har förändrats under respektive år.

Om fonden har betalat utdelning under året, har man vid beräkning av värdeförändringen räknat som om utdelningen återinvesteras på utdelningsdagen. Årsavkastningen mäts i procent från föregående års bokslutsdag till årsskiftets bokslutsdag. Vid halvårsredogörelse redovisas avkastningen för första halvåret innevarande år.

**Transaktionskostnader** – Uttrycks dels som belopp, dels i procent av värdet på de finansiella instrument som omsatts. Med värdet avses generellt marknadsvärdet men för exempelvis terminer och terminsliknande instrument avses exponeringsvärdet. Beräknas på rullande 12 månader och ingår i posten "Övriga kostnader" i resultaträkningen. Exempel på transaktionskostnader är courtage och kostnader för derivat.

**Utdelning per andel** – Fondbolaget fattar årligen beslut om den utdelning som ska betalas till fondbolagets ägare av den utdelande andelsklassen. Utdelning tillkommer fondbolagets ägare som på fondbolagets fastställt avstämningsdag är registrerad för utdelande fondbandel.

**Uttagen förvaltningskostnad i % av genomsnittlig fondförmögenhet** – Kostnaden beräknas dagligen och utgör kostnaden för förvaltning, administration, förvaring och tillsyn av fonden. Uttrycks i procent av den genomsnittliga fondförmögenheten och beräknas på rullande 12 månader.

**Övriga finansiella intäkter** i resultaträkningen innehåller premier för utlånade värdepapper och rabatt på förvaltningskostnad i underliggande fonder.

**Övriga finansiella kostnader** i resultaträkningen innehåller kostnader för utlånade värdepapper.

**Övriga intäkter i resultaträkningen** avser pengar som betalats tillbaka gällande bankkostnader och skatter.

**Övriga kostnader i resultaträkningen** innehåller transaktionskostnader, skattekostnader och bankkostnader.

**Övriga skulder i balansräkningen** innehåller skulder för ej likviderade affärer, där likviden betalas efter balansdagen. Det gäller både köpta värdepapper och inlösen av fondbandelar.

**Övriga tillgångar i balansräkningen** innehåller fordringar för ej likviderade affärer, där likviden erhålls efter balansdagen. Det gäller både sålda värdepapper och utgivna fondbandelar.

## Nyckeltal vid riskuppföljning

För att få relevanta jämförelser har utdelningar återinvesterats i fonderna och deras referensindex. Samtliga nyckeltal har vidare beräknats utifrån årseffektiva avkastningar. För de flesta fonderna har värdena under de senaste två åren använts. För yngre fonder har en prognos för risken gjorts med fondens innehav per balansdagen som underlag, i dessa fall används då historisk data för relevanta referensportföljer för prognostiserad riskberäkning.

**Total risk/Total risk i index** anges som standardavvikelsen för variationerna i fondens/index månatliga avkastningar. Ju högre siffra, desto högre risk.

**Aktiv risk** mäts som standardavvikelsen för skillnaden i avkastning mellan fonden och dess referensindex (variationen i den relativa avkastningen). Den historiska aktiva risken anger alltså hur mycket fondens avkastning har avvikit från sitt referensindex. (Måttet kallas även "tracking error").

**Aktiv avkastning** anger den årseffektiva över- eller underavkastning som fonden har uppnått jämfört med sitt referensindex.

**Sharpekvot/Sharpekvot index** är ett mått på fondens/index avkastning med hänsyn

tagen till den risk som fonden/index har haft. En hög avkastning som uppnåtts till en lägre risk är bättre än en lika hög avkastning som uppnåtts med en hög risk. Beräknas som kvoten mellan avkastningen minus den riskfria räntan (statspappersräntan) å ena sidan, och fondens/index totala risk, å den andra. Sharpekvoten är mest relevant för att jämföra hur olika marknader avkastar med hänsyn till dess risk.

**Informationskvot** är ett mått på den aktiva avkastningen som fonden uppnått genom att avvika från sitt referensindex. Det är kvoten mellan den aktiva avkastningen och den aktiva risken. Negativ informationskvot innebär att fonden har gett en lägre avkastning än sitt referensindex.

## Förkortningar

I innehavsförteckningarna förekommer förkortningar vid namnen på vissa värdepapper.

<b>ADR</b> American Depository Receipt	<b>IR</b> Inlösenrätt
<b>ADS</b> American Depository Share	<b>KV</b> Konvertibel
<b>BTA</b> Betald teckningsaktie	<b>NVDR</b> Non Voting Depository Receipt
<b>CB</b> Callable Bond	<b>Pref</b> Preferensaktie
<b>EF</b> Exchange Traded Fund	<b>SDB</b> Svenskt depåbevis
<b>f/r</b> Foreign Registered	<b>TO</b> Teckningsoption
<b>FRN</b> Floating Rate Note	<b>TR</b> Teckningsrätt
<b>GDR</b> Global Depository Receipt	

**Active Share** jämför aktiefondens innehav med innehaven i dess jämförelseindex. Nyckeltalet anges i procent, från 0% (exakt samma fördelning som index) till 100% (inga av fondens innehav ingår index). Måttet beräknas som halva summan av de absoluta avvikelserna mellan ett värdepappers vikt i fonden och dess vikt i index.

**Index** visar genomsnittlig avkastning på den underliggande marknaden fonden placerar på.

**Spreadexponering** anges för räntefonder, per balansdagen, och är ett mått på kreditrisk. Visar hur stort värdefall det blir i en räntefond, mätt i procent av fondens värde,

om ränteskillnaden mellan fondens innehav och statsobligationer fördubblas. Beräknas som kapitalviktad kreditduration, multiplicerat med instrumentens spread (differens) i förhållande till statspapperskurvan.

**VaR** är i detta fall parametriskt och beräknat enligt varians-kovariansmetoden. Kovariansmatrisen är given av risksystemet och uppdateras månadsvis (half-life 24 månader för räntemodulen och 12 månader för aktiemodulen). Sannolikhetsnivån är 95% och horisonten 1 dag.

[Informationsbroschyr, fondbestämmelser och faktablad finns under respektive fond i kurslistan som du hittar på handelsbankenfonder.se.](#)

Handelsbanken Fonder AB är ett helägt dotterbolag till Svenska Handelsbanken AB (publ).

#### **Om risk**

Historisk avkastning är ingen garanti för framtiden. Fonder kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det insatta beloppet. En fond med risknivå 5-7 enligt fondens faktablad, kan variera kraftigt i värde till följd av fondens sammansättning och förvaltningsmetodik. Sammanfattning av investerares rättigheter samt informationsbroschyr, fondbestämmelser och faktablad för respektive fond finns på [handelsbankenfonder.se](#).